

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II)

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
"übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Jahresbericht per 30. September 2020

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I.....	27
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	27
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	27
Pauschale Verwaltungskommission	28
Benchmark.....	28
TER.....	28
Ausschüttung des Nettoertrags 2019 / 2020	28
Thesaurierung des Nettoertrags 2019 / 2020.....	29
Erklärung der Fussnoten	29
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	30
Pflichtpublikationen.....	31
Bericht der Prüfgesellschaft.....	33

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 29.01.2021

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

Regina Kleeb, Mitglied
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement
Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer

Andreas Hogg
stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

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

Übersicht	von	01.10.2019	01.10.2018	01.10.2017	01.10.2016
	bis	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2018	30.09.2017
Konsolidiert		USD			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		171'259'864.32	153'464'614.76	193'244'287.36	185'832'099.23
Klasse DA USD		USD			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		29'617'099.33	29'836'009.55	29'868'849.88	24'902'063.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		319'589.566	336'240.432	355'395.000	285'083.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.6723	88.7300	84.0400	87.3500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	84.0400	87.3500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		85.1427	-	-	-
Ausschüttung je Anteil		1.60	1.80	1.80	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.23 %	0.25 %
Klasse FA USD		USD			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		346'767.63	366'650.53	443'951.04	453'360.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'745.442	4'135.000	5'283.000	5'196.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.5839	88.6700	84.0300	87.2500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	84.0300	87.2500
Ausschüttung je Anteil		1.40	1.80	1.80	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.24 %	0.36 %	0.40 %
Klasse GT USD		USD			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'036'948.16	36'181'623.72	33'881'882.07	22'598'592.73
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		220'168.634	350'977.979	351'310.682	228'596.715
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		109.1752	103.0900	96.4400	98.8600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	96.4400	98.8600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		100.3047	-	-	-
Thesaurierung je Anteil		1.88	2.07	2.60	2.18
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.15 %	0.15 %
Klasse NT USD		USD			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		92'225'504.85	87'080'330.96	129'049'604.37	123'986'015.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		870'556.627	871'338.627	1'383'438.230	1'297'939.963
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		105.9385	99.9400	93.2800	95.5300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	93.2800	95.5300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		97.3310	-	-	-
Thesaurierung je Anteil		1.96	2.14	2.27	2.25
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		25'033'544.35			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		227'591.107			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.0565			
Thesaurierung je Anteil		2.01			
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %			

Klasse PV	USD			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	-	-	-	13'892'066.78
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	-	-	-	144'952.621
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾	-	-	-	95.84
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP	-	-	-	95.84
Thesaurierung je Anteil	-	-	-	2.16
Total Expense Ratio (TER)	-	-	-	0.10 %

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

Performance	YTD / 30.09.2020	2019	2018	2017
Klasse DA USD	7.03 %	5.63 %	-1.05 %	7.18 %
Klasse FA USD	7.02 %	5.57 %	-1.15 %	7.03 %
Klasse GT USD	7.06 %	5.68 %	-0.97 %	7.30 %
Klasse NT USD	7.18 %	5.81 %	-0.83 %	7.46 %
Klasse NTH CHF (Lancierung 28.02.2020)	1.06 %	-	-	-
Klasse PV (Schliessung 22.06.2018)	-	-	-1.21 %	7.36 %
Benchmark	7.15 %	5.89 %	-0.85 %	7.50 %
Tracking Error *	-	0.07 %	0.04 %	0.10 %

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 Error: Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.

Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

Vermögensrechnung (Verkehrswerte)

	30.09.2020	30.09.2019
Bankguthaben auf Sicht	932'952.14	856'411.93
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	169'335'519.29	151'621'815.44
Derivative Finanzinstrumente	-1'909.23	0.00
Sonstige Vermögenswerte	1'000'512.03	995'374.46
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	171'267'074.23	153'473'601.83
Andere Verbindlichkeiten	-7'209.91	-8'987.07
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	171'259'864.32	153'464'614.76

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DA USD	von	01.10.2019	01.10.2018
		bis	30.09.2020	30.09.2019
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			336'240.432	355'395.000
Ausgegebene Anteile			20'746.025	23'081.000
Zurückgenommene Anteile			-37'396.891	-42'235.568
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			319'589.566	336'240.432

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse FA USD	von	01.10.2019	01.10.2018
		bis	30.09.2020	30.09.2019
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			4'135.000	5'283.000
Ausgegebene Anteile			1'124.417	225.000
Zurückgenommene Anteile			-1'513.975	-1'373.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			3'745.442	4'135.000

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse GT USD	von	01.10.2019	01.10.2018
		bis	30.09.2020	30.09.2019
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			350'977.979	351'310.682
Ausgegebene Anteile			9'603.000	29'011.000
Zurückgenommene Anteile			-140'412.345	-29'343.703
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			220'168.634	350'977.979

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT USD	von	01.10.2019	01.10.2018
		bis	30.09.2020	30.09.2019
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			871'338.627	1'383'438.230
Ausgegebene Anteile			325'047.000	207'565.000
Zurückgenommene Anteile			-325'829.000	-719'664.603
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			870'556.627	871'338.627

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NTH CHF	von	<i>Lancierung</i> 28.02.2020	
		bis	30.09.2020	
Ausgegebene Anteile			228'772.107	
Zurückgenommene Anteile			-1'181.000	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			227'591.107	

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	von	01.10.2019	01.10.2018
		bis	30.09.2020	30.09.2019
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			153'464'614.76	193'244'287.36
Ausbezahlte Ausschüttung			-606'319.98	-628'641.78
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-918'265.96	-1'000'665.37
Saldo aus dem Anteilverkehr			8'400'841.41	-48'931'036.09
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			10'918'994.09	10'780'670.64
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			171'259'864.32	153'464'614.76

Erfolgsrechnung	(konsolidiert)	von	01.10.2019	01.10.2018
		bis	30.09.2020	30.09.2019
Ertrag				
Erträge der Bankguthaben auf Sicht			1'434.30	3'857.16
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-1'559.22	-196.14
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			3'041'118.49	3'419'056.75
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			454'848.40	277'614.19
Total Ertrag			3'495'841.97	3'700'331.96
Aufwand				
Passivzinsen			-231.63	-270.89
Reglementarische Vergütungen			-98'291.18	-101'554.78
Sonstige Aufwendungen			-77.18	-0.18
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-301'731.44	-413'893.87
Total Aufwand			-400'331.43	-515'719.72
Nettoertrag / Verlust			3'095'510.54	3'184'612.24
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-1'376.07	-4'094'611.24
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen			60'263.54	30'939.21
Realisierter Erfolg			3'154'398.01	-879'059.79
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			7'764'596.08	11'659'730.43
Gesamterfolg			10'918'994.09	10'780'670.64

Verwendung des Erfolges	Klasse DA USD	30.09.2020	30.09.2019
Nettoertrag		500'701.99	587'417.76
Vortrag des Vorjahres		26'943.16	44'758.18
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		527'645.15	632'175.94
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		511'343.31	605'232.78
Vortrag auf neue Rechnung		16'301.84	26'943.16
Total		527'645.15	632'175.94

Verwendung des Erfolges	Klasse FA USD	30.09.2020	30.09.2019
Nettoertrag		5'805.52	6'914.53
Vortrag des Vorjahres		38.09	566.56
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		5'843.61	7'481.09
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		5'243.62	7'443.00
Vortrag auf neue Rechnung		599.99	38.09
Total		5'843.61	7'481.09

Verwendung des Erfolges	Klasse GT USD	30.09.2020	30.09.2019
Nettoertrag		414'844.84	726'454.29
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		414'844.84	726'454.29
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		145'195.69	254'259.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		269'649.15	472'195.29
Total		414'844.84	726'454.29

Verwendung des Erfolges	Klasse NT USD	30.09.2020	30.09.2019
Nettoertrag		1'714'710.31	1'863'825.66
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		1'714'710.31	1'863'825.66
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		600'148.61	652'338.98
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		1'114'561.70	1'211'486.68
Total		1'714'710.31	1'863'825.66

Verwendung des Erfolges	Klasse NTH CHF	30.09.2020	
Nettoertrag		459'447.88	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		459'447.88	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		160'806.76	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		298'641.12	
Total		459'447.88	

Inventar des Fondsvermogens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveranderungen wahrend der Periode

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Borse kotiert sind								169'335'519.29	98.87	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								169'335'519.29	98.87	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	130	0	0	130	EUR	146.87 %	223'893.55	0.13	a)
AT0000A001X2	3.5000 % RAGB 3 1/2 09/15/21	80	0	80	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	200	0	60	140	EUR	170.60 %	280'068.95	0.16	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	150	0	0	150	EUR	130.45 %	229'458.12	0.13	a)
AT0000A0N9A0	3.6500 % RAGB 3.65 04/20/22	0	75	0	75	EUR	106.66 %	93'806.07	0.05	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	0	10	0	10	EUR	239.88 %	28'129.51	0.02	a)
AT0000A0U3T4	3.4000 % RAGB 3.4 11/22/22	200	0	60	140	EUR	108.73 %	178'503.00	0.10	a)
AT0000A105W3	1.7500 % RAGB 1 3/4 10/20/23	0	60	0	60	EUR	107.40 %	75'565.51	0.04	a)
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	250	0	0	250	EUR	109.39 %	320'690.22	0.19	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	150	0	0	150	EUR	135.84 %	238'937.23	0.14	a)
AT0000A1PE50	0.0000 % RAGB 0 07/15/23	0	80	0	80	EUR	101.80 %	95'500.55	0.06	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/86	0	20	0	20	EUR	161.75 %	37'935.20	0.02	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/17	30	12	0	42	EUR	212.58 %	104'698.34	0.06	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	0	60	0	60	EUR	109.27 %	76'881.22	0.04	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	0	80	0	80	EUR	107.88 %	101'204.31	0.06	a)
AT								2'085'271.78	1.22	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	125	120	0	245	AUD	115.79 %	203'338.61	0.12	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	0	170	0	170	AUD	106.39 %	129'634.77	0.08	a)
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	0	100	0	100	AUD	103.50 %	74'183.63	0.04	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	0	75	0	75	AUD	99.96 %	53'736.90	0.03	a)
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	0	180	0	180	AUD	101.53 %	130'990.22	0.08	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	0	110	0	110	AUD	100.55 %	79'272.98	0.05	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	0	170	0	170	AUD	101.07 %	123'152.49	0.07	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	0	50	0	50	AUD	100.28 %	35'936.41	0.02	a)
AU0000XCLWM5	5.7500 % ACGB 5 3/4 05/15/21 124	280	0	280	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU0000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	100	0	0	100	AUD	141.83 %	101'654.50	0.06	a)
AU0000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	450	0	100	350	AUD	121.08 %	303'736.79	0.18	a)
AU0000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	0	50	0	50	AUD	121.79 %	43'644.70	0.03	a)
AU0000XCLWAN8	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/20 146	220	0	220	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU0000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	100	0	0	100	AUD	129.96 %	93'147.40	0.05	a)
AU0000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	100	110	0	210	AUD	115.17 %	173'357.03	0.10	a)
AU0000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	140	50	0	190	AUD	112.04 %	152'577.51	0.09	a)
AU0000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	100	0	0	100	AUD	128.85 %	92'351.80	0.05	a)
AU0000XCLWAT5	2.0000 % ACGB 2 12/21/21 151	0	140	0	140	AUD	102.29 %	102'637.88	0.06	a)
AU0000XCLWAU3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	200	0	0	200	AUD	116.33 %	166'751.89	0.10	a)
AU0000XCLWAW9	2.2500 % ACGB 2 1/4 11/21/22 153	0	180	0	180	AUD	104.40 %	134'690.37	0.08	a)
AU0000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	160	50	0	210	AUD	117.50 %	176'859.57	0.10	a)
AU3TB0000051	5.7500 % ACGB 5 3/4 07/15/22 128	160	0	0	160	AUD	109.95 %	126'095.25	0.07	a)
AU3TB0000101	5.5000 % ACGB 5 1/2 04/21/23 133	140	80	0	220	AUD	113.56 %	179'059.20	0.10	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	240	0	0	240	AUD	127.31 %	218'996.94	0.13	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	290	0	0	290	AUD	109.03 %	226'624.95	0.13	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	160	80	0	240	AUD	120.98 %	208'101.20	0.12	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	0	240	0	240	AUD	113.35 %	194'991.55	0.11	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	100	0	0	100	AUD	136.97 %	98'171.81	0.06	a)
AU								3'623'696.35	2.12	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	510	0	130	380	EUR	145.39 %	647'880.90	0.38	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	150	0	0	150	EUR	174.00 %	306'059.66	0.18	a)
BE0000308172	4.0000 % BGB 4 03/28/22 48	0	140	0	140	EUR	106.98 %	175'636.57	0.10	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	200	0	50	150	EUR	180.93 %	318'251.11	0.19	a)
BE0000321308	4.2500 % BGB 4 1/4 09/28/21 61	70	0	70	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
BE0000325341	4.2500 % BGB 4 1/4 09/28/22 65	0	70	0	70	EUR	109.87 %	90'183.34	0.05	a)
BE0000328378	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/23 68	0	70	0	70	EUR	108.02 %	88'668.69	0.05	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	750	0	350	400	EUR	106.76 %	500'768.08	0.29	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	0	110	0	110	EUR	113.32 %	146'173.06	0.09	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	0	50	0	50	EUR	109.02 %	63'921.10	0.04	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	150	0	0	150	EUR	131.73 %	231'709.60	0.14	a)
BE0000339482	0.2000 % BGB 0.2 10/22/23 79	150	0	0	150	EUR	102.65 %	180'558.65	0.11	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	50	0	0	50	EUR	168.01 %	98'508.39	0.06	a)
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	0	35	0	35	EUR	161.11 %	66'123.93	0.04	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	0	65	0	65	EUR	123.17 %	93'882.88	0.05	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	190	0	0	190	EUR	117.87 %	262'618.29	0.15	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	0	60	0	60	EUR	111.22 %	78'253.22	0.05	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	0	40	0	40	EUR	136.79 %	64'163.61	0.04	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	0	100	0	100	EUR	103.86 %	121'791.34	0.07	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	0	30	0	30	EUR	103.87 %	36'540.92	0.02	a)
BE								3'571'693.34	2.09	
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	190	0	0	190	CAD	103.45 %	147'148.12	0.09	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	230	0	0	230	CAD	108.17 %	186'252.22	0.11	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	50	0	0	50	CAD	158.02 %	59'148.79	0.03	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	170	0	0	170	CAD	140.19 %	178'422.68	0.10	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	0	0	100	CAD	109.09 %	81'669.47	0.05	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	135	0	0	135	CAD	106.52 %	107'655.36	0.06	a)
CA135087F254	0.7500 % CAN 0 3/4 03/01/21	350	0	350	0	CAD	0.00 %	0.00	0.00	
CA135087F585	0.7500 % CAN 0 3/4 09/01/21	200	0	100	100	CAD	100.45 %	75'200.45	0.04	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	100	0	0	100	CAD	104.01 %	77'866.37	0.05	a)
CA135087G328	0.5000 % CAN 0 1/2 03/01/22	270	0	0	270	CAD	100.46 %	203'057.38	0.12	a)
CA135087G732	1.0000 % CAN 1 09/01/22	200	0	0	200	CAD	101.42 %	151'853.27	0.09	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	0	100	0	100	CAD	111.67 %	83'597.98	0.05	a)
CA135087H490	1.7500 % CAN 1 3/4 03/01/23	0	80	0	80	CAD	103.67 %	62'089.46	0.04	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	0	65	0	65	CAD	123.36 %	60'030.17	0.04	a)
CA135087H987	2.0000 % CAN 2 09/01/23	0	50	0	50	CAD	104.95 %	39'283.55	0.02	a)
CA135087J967	1.5000 % CAN 1 1/2 09/01/24	100	0	0	100	CAD	104.69 %	78'375.44	0.05	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	0	100	0	100	CAD	104.08 %	77'919.52	0.05	a)
CA135087K866	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/22	0	65	0	65	CAD	101.98 %	49'623.36	0.03	a)
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	0	90	0	90	CAD	100.69 %	67'840.09	0.04	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	0	90	0	90	CAD	144.22 %	97'169.01	0.06	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	470	0	150	320	CAD	161.19 %	386'160.88	0.23	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	50	0	0	50	CAD	164.71 %	61'653.38	0.04	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	0	20	0	20	CAD	156.96 %	23'501.70	0.01	a)
CA135087ZJ69	3.2500 % CAN 3 1/4 06/01/21	140	0	140	0	CAD	0.00 %	0.00	0.00	
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	0	85	0	85	CAD	154.30 %	98'185.74	0.06	a)
CA135087ZU15	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/22	0	180	0	180	CAD	104.31 %	140'566.42	0.08	a)
CA								2'594'270.81	1.51	
DE0001102309	1.5000 % DBR 1 1/2 02/15/23	200	0	0	200	EUR	105.33 %	247'032.61	0.14	a)
DE0001102317	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/23	200	0	0	200	EUR	105.89 %	248'336.60	0.14	a)
DE0001102325	2.0000 % DBR 2 08/15/23	300	0	125	175	EUR	107.95 %	221'521.92	0.13	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	365	0	100	265	EUR	108.52 %	337'215.66	0.20	a)
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	150	80	0	230	EUR	170.12 %	458'821.37	0.27	a)
DE0001102358	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/24	250	0	0	250	EUR	108.23 %	317'292.47	0.19	a)
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	100	0	0	100	EUR	106.82 %	125'264.73	0.07	a)
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	0	200	0	200	EUR	105.50 %	247'436.00	0.14	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	250	0	0	250	EUR	108.59 %	318'333.20	0.19	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	300	0	0	300	EUR	106.72 %	375'424.79	0.22	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	100	0	0	100	EUR	104.28 %	122'285.02	0.07	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	375	0	60	315	EUR	106.21 %	392'334.33	0.23	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	200	0	0	200	EUR	108.34 %	254'084.92	0.15	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	90	50	0	140	EUR	138.89 %	228'010.37	0.13	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	100	80	0	180	EUR	108.77 %	229'590.39	0.13	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	0	200	0	200	EUR	107.19 %	251'397.21	0.15	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	0	30	0	30	EUR	107.45 %	37'798.94	0.02	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	0	110	0	110	EUR	103.06 %	132'935.96	0.08	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	0	25	0	25	EUR	105.31 %	30'872.92	0.02	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	0	80	0	80	EUR	104.87 %	98'377.76	0.06	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	0	120	0	120	EUR	104.77 %	147'425.92	0.09	a)
DE0001104768	0.0000 % BKO 0 06/11/21	0	100	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001104776	0.0000 % BKO 0 09/10/21	0	150	0	150	EUR	100.60 %	176'947.48	0.10	a)
DE0001104784	0.0000 % BKO 0 12/10/21	0	50	0	50	EUR	100.80 %	59'101.52	0.03	a)
DE0001104792	0.0000 % BKO 0 03/11/22	0	100	0	100	EUR	100.96 %	118'391.83	0.07	a)
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27 97	0	70	0	70	EUR	149.77 %	122'936.08	0.07	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28 98	0	130	0	130	EUR	146.84 %	223'846.29	0.13	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28 98	0	100	0	100	EUR	142.98 %	167'670.06	0.10	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30 00	595	0	100	495	EUR	165.26 %	959'276.18	0.56	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31 00	0	150	0	150	EUR	163.79 %	288'093.51	0.17	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34 03	60	110	0	170	EUR	173.61 %	346'088.16	0.20	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37 05	175	40	0	215	EUR	173.04 %	436'277.78	0.25	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39 2007	0	90	0	90	EUR	188.16 %	198'577.93	0.12	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40 08	280	0	70	210	EUR	202.82 %	499'447.21	0.29	a)
DE0001135424	2.5000 % DBR 2 1/2 01/04/21	950	0	950	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	0	75	0	75	EUR	178.26 %	156'772.93	0.09	a)
DE0001135440	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/21	0	100	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001135457	2.2500 % DBR 2 1/4 09/04/21	0	120	70	50	EUR	102.68 %	60'200.87	0.04	a)
DE0001135465	2.0000 % DBR 2 01/04/22	250	0	0	250	EUR	103.43 %	303'214.82	0.18	a)
DE0001135473	1.7500 % DBR 1 3/4 07/04/22	120	80	0	200	EUR	104.32 %	244'652.13	0.14	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	220	0	0	220	EUR	165.84 %	427'830.95	0.25	a)
DE0001135499	1.5000 % DBR 1 1/2 09/04/22	0	130	0	130	EUR	104.28 %	158'961.38	0.09	a)
DE0001141745	0.0000 % OBL 0 10/08/21 174	0	150	0	150	EUR	100.65 %	177'031.91	0.10	a)
DE0001141752	0.0000 % OBL 0 04/08/22 175	0	120	0	120	EUR	101.02 %	142'158.85	0.08	a)
DE0001141760	0.0000 % OBL 0 10/07/22 176	0	140	0	140	EUR	101.42 %	166'508.67	0.10	a)
DE0001141786	0.0000 % OBL 0 10/13/23 178	0	100	0	100	EUR	102.27 %	119'923.31	0.07	a)
DE0001141794	0.0000 % OBL 0 04/05/24 179	0	70	0	70	EUR	102.62 %	84'233.62	0.05	a)
DE0001141802	0.0000 % OBL 0 10/18/24 180	0	150	0	150	EUR	102.97 %	181'126.80	0.11	a)
DE								10'641'063.36	6.21	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	800	0	0	800	DKK	190.07 %	239'536.84	0.14	a)
DK0009923054	1.5000 % DGB 1 1/2 11/15/23	1'000	0	0	1'000	DKK	106.66 %	168'028.04	0.10	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	550	0	0	550	DKK	111.90 %	96'955.61	0.06	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27 10Y	400	0	0	400	DKK	107.25 %	67'583.00	0.04	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29 10YR	0	600	0	600	DKK	108.56 %	102'608.95	0.06	a)
DK								674'712.44	0.39	
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	700	0	70	630	EUR	149.18 %	1'102'068.48	0.64	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	0	80	0	80	EUR	176.52 %	165'595.48	0.10	a)
ES00000121G2	4.8000 % SPGB 4.8 01/31/24	0	130	0	130	EUR	117.38 %	178'943.64	0.10	a)
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	75	25	0	100	EUR	174.48 %	204'604.99	0.12	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	750	0	200	550	EUR	123.90 %	799'133.55	0.47	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	650	0	100	550	EUR	135.64 %	874'851.44	0.51	a)
ES00000123K0	5.8500 % SPGB 5.85 01/31/22	0	130	0	130	EUR	108.50 %	165'394.62	0.10	a)
ES00000123U9	5.4000 % SPGB 5.4 01/31/23	120	0	0	120	EUR	113.71 %	160'007.46	0.09	a)
ES00000123X3	4.4000 % SPGB 4.4 10/31/23	200	0	0	200	EUR	114.94 %	269'560.63	0.16	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	120	50	0	170	EUR	162.78 %	324'507.19	0.19	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	175	0	0	175	EUR	191.92 %	393'849.68	0.23	a)
ES00000124W3	3.8000 % SPGB 3.8 04/30/24	100	50	0	150	EUR	115.03 %	202'327.88	0.12	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	0	170	0	170	EUR	116.98 %	233'203.74	0.14	a)
ES00000128B8	0.7500 % SPGB 0 3/4 07/30/21	500	0	500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	100	0	0	100	EUR	144.60 %	169'565.26	0.10	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	80	20	0	100	EUR	173.43 %	203'371.46	0.12	a)
ES00000128O1	0.4000 % SPGB 0.4 04/30/22	220	0	0	220	EUR	101.43 %	261'661.49	0.15	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	0	40	0	40	EUR	110.64 %	51'895.89	0.03	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	100	0	0	100	EUR	123.86 %	145'247.65	0.08	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	370	0	100	270	EUR	156.16 %	494'413.10	0.29	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	0	170	0	170	EUR	110.48 %	220'240.22	0.13	a)
ES0000012A97	0.4500 % SPGB 0.45 10/31/22	150	0	0	150	EUR	101.94 %	179'316.91	0.10	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	100	50	0	150	EUR	110.58 %	194'503.30	0.11	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	60	60	0	120	EUR	141.21 %	198'709.77	0.12	a)
ES0000012B62	0.3500 % SPGB 0.35 07/30/23	100	0	0	100	EUR	102.18 %	119'825.46	0.07	a)
ES0000012C46	0.0500 % SPGB 0.05 10/31/21	0	50	0	50	EUR	100.58 %	58'972.36	0.03	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	0	30	0	30	EUR	118.32 %	41'624.00	0.02	a)
ES0000012E85	0.2500 % SPGB 0 1/4 07/30/24 5YR	0	120	0	120	EUR	102.33 %	143'991.15	0.08	a)
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	0	100	0	100	EUR	104.14 %	122'118.51	0.07	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	0	130	0	130	EUR	102.96 %	156'959.79	0.09	a)
ES0000012F84	0.0000 % SPGB 0 04/30/23	0	130	0	130	EUR	101.09 %	154'101.46	0.09	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	0	50	0	50	EUR	98.51 %	57'760.01	0.03	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	0	120	0	120	EUR	105.79 %	148'859.83	0.09	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	0	120	0	120	EUR	109.92 %	154'672.89	0.09	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	0	70	0	70	EUR	107.02 %	87'847.02	0.05	a)
ES								8'439'706.31	4.93	
FI4000020961	3.5000 % RFGB 3 1/2 04/15/21	100	0	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	50	0	0	50	EUR	125.49 %	73'579.63	0.04	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	40	0	0	40	EUR	157.76 %	73'997.44	0.04	a)
FI4000047089	1.6250 % RFGB 1 5/8 09/15/22	0	50	0	50	EUR	104.50 %	61'270.33	0.04	a)
FI4000079041	2.0000 % RFGB 2 04/15/24	130	0	40	90	EUR	109.54 %	115'604.68	0.07	a)
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	140	0	0	140	EUR	111.42 %	182'915.91	0.11	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	0	30	0	30	EUR	107.57 %	37'842.91	0.02	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	0	50	0	50	EUR	106.18 %	62'253.01	0.04	a)
FI4000219787	0.0000 % RFGB 0 09/15/23	90	0	0	90	EUR	101.98 %	107'623.86	0.06	a)
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	0	30	0	30	EUR	135.02 %	47'500.38	0.03	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	0	50	0	50	EUR	107.12 %	62'807.67	0.04	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	0	20	0	20	EUR	104.99 %	24'623.99	0.01	a)
FI								850'019.81	0.50	
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	250	40	50	240	EUR	172.71 %	486'067.75	0.28	a)
FR0000571085	8.5000 % FRTR 8 1/2 04/25/23	200	0	0	200	EUR	123.71 %	290'136.85	0.17	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	125	110	0	235	EUR	134.10 %	369'542.78	0.22	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	300	50	60	290	EUR	151.34 %	514'659.29	0.30	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	230	30	50	210	EUR	170.81 %	420'630.42	0.25	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	80	40	0	120	EUR	214.42 %	301'727.31	0.18	a)
FR0010192997	3.7500 % FRTR 3 3/4 04/25/21	500	0	500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	185	20	0	205	EUR	170.87 %	410'759.64	0.24	a)
FR0010466938	4.2500 % FRTR 4 1/4 10/25/23	650	0	250	400	EUR	115.22 %	540'450.53	0.32	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	250	70	60	260	EUR	187.89 %	572'855.52	0.33	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	150	0	30	120	EUR	226.92 %	319'317.05	0.19	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	400	0	150	250	EUR	123.09 %	360'853.45	0.21	a)
FR0011059088	3.2500 % FRTR 3 1/4 10/25/21	500	0	110	390	EUR	104.15 %	476'312.49	0.28	a)
FR0011196856	3.0000 % FRTR 3 04/25/22	500	0	0	500	EUR	105.72 %	619'862.33	0.36	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	280	50	0	330	EUR	123.29 %	477'100.51	0.28	a)
FR0011337880	2.2500 % FRTR 2 1/4 10/25/22	200	80	0	280	EUR	106.02 %	348'107.93	0.20	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	150	30	0	180	EUR	170.64 %	360'181.53	0.21	a)
FR0011486067	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/23	0	180	0	180	EUR	106.42 %	224'627.98	0.13	a)
FR0011619436	2.2500 % FRTR 2 1/4 05/25/24	290	0	0	290	EUR	110.64 %	376'251.51	0.22	a)
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	300	60	0	360	EUR	127.47 %	538'119.30	0.31	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	200	0	0	200	EUR	109.96 %	257'889.00	0.15	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	200	100	0	300	EUR	105.22 %	370'158.42	0.22	a)
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	200	60	0	260	EUR	108.30 %	330'194.54	0.19	a)
FR0012968337	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/20	180	0	180	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	260	50	0	310	EUR	118.72 %	431'572.40	0.25	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	150	120	0	270	EUR	106.03 %	335'707.17	0.20	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	0	80	0	80	EUR	150.59 %	141'271.39	0.08	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	220	0	0	220	EUR	119.34 %	307'876.68	0.18	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	210	80	0	290	EUR	104.80 %	356'391.52	0.21	a)
FR0013219177	0.0000 % FRTR 0 05/25/22	0	60	0	60	EUR	101.07 %	71'111.79	0.04	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	100	70	0	170	EUR	130.53 %	260'212.01	0.15	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	200	30	0	230	EUR	110.07 %	296'869.03	0.17	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	200	30	40	190	EUR	143.79 %	320'368.91	0.19	a)
FR0013283686	0.0000 % FRTR 0 03/25/23	200	0	0	200	EUR	101.62 %	238'329.21	0.14	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	300	0	0	300	EUR	109.17 %	384'054.32	0.22	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	100	120	0	220	EUR	118.18 %	304'884.08	0.18	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	120	190	50	260	EUR	109.50 %	333'853.21	0.19	a)
FR0013344751	0.0000 % FRTR 0 03/25/24	0	125	0	125	EUR	102.21 %	149'820.58	0.09	a)
FR0013398583	0.0000 % FRTR 0 02/25/22	0	50	0	50	EUR	100.92 %	59'171.88	0.03	a)
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	100	90	0	190	EUR	131.33 %	292'607.62	0.17	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	100	180	60	220	EUR	107.58 %	277'537.91	0.16	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	100	190	0	290	EUR	102.75 %	349'420.12	0.20	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	0	300	0	300	EUR	102.96 %	362'207.86	0.21	a)
FR0013479102	0.0000 % FRTR 0 02/25/23	0	60	0	60	EUR	101.53 %	71'435.44	0.04	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	0	70	0	70	EUR	109.45 %	89'842.51	0.05	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	0	120	0	120	EUR	102.98 %	144'911.29	0.08	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	0	40	0	40	EUR	106.17 %	49'800.06	0.03	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	0	70	0	70	EUR	102.50 %	84'137.58	0.05	a)
FR								14'679'200.70	8.57	
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	0	60	0	60	GBP	144.74 %	112'271.92	0.07	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	220	0	40	180	GBP	155.01 %	360'714.47	0.21	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	0	100	0	100	GBP	171.40 %	221'585.92	0.13	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	465	0	150	315	GBP	208.64 %	849'648.84	0.50	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	60	40	0	100	GBP	182.79 %	236'310.91	0.14	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	90	0	0	90	GBP	130.21 %	151'501.94	0.09	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	90	50	0	140	GBP	177.45 %	321'170.30	0.19	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	310	0	50	260	GBP	145.60 %	489'402.37	0.29	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	0	20	0	20	GBP	191.40 %	49'488.38	0.03	a)
GB00B3KJDQ49	4.0000 % UKT 4 03/07/22	425	0	120	305	GBP	105.76 %	417'015.91	0.24	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	70	15	0	85	GBP	164.21 %	180'447.08	0.11	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	170	0	60	110	GBP	154.55 %	219'782.46	0.13	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	70	0	0	70	GBP	212.65 %	192'439.74	0.11	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	210	0	75	135	GBP	167.05 %	291'549.02	0.17	a)
GB00B6RNNH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	90	0	0	90	GBP	185.16 %	215'437.36	0.13	a)
GB00B7L9SL19	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/22	0	165	0	165	GBP	103.44 %	220'649.93	0.13	a)
GB00B7Z53659	2.2500 % UKT 2 1/4 09/07/23	380	0	150	230	GBP	106.80 %	317'563.39	0.19	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	170	0	0	170	GBP	153.38 %	337'092.43	0.20	a)
GB00BBJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	100	20	0	120	GBP	214.04 %	332'053.09	0.19	a)
GB00BD0PCK97	0.5000 % UKT 0 1/2 07/22/22	0	75	0	75	GBP	100.96 %	97'890.82	0.06	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	100	50	0	150	GBP	117.85 %	228'534.72	0.13	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	180	0	0	180	GBP	108.27 %	251'948.62	0.15	a)
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/71	70	0	0	70	GBP	143.71 %	130'051.80	0.08	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	0	70	0	70	GBP	103.86 %	93'989.15	0.05	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	70	0	0	70	GBP	125.17 %	113'273.84	0.07	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	180	0	0	180	GBP	112.33 %	261'396.40	0.15	a)
GB00BHFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	290	0	0	290	GBP	111.14 %	416'677.20	0.24	a)
GB00BJMHBS34	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	0	190	0	190	GBP	106.26 %	261'008.56	0.15	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	0	30	0	30	GBP	110.05 %	42'681.79	0.02	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	0	190	0	190	GBP	103.22 %	253'541.35	0.15	a)
GB00BL68HG94	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/23	0	185	0	185	GBP	100.35 %	240'005.09	0.14	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	0	20	0	20	GBP	92.82 %	23'999.54	0.01	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	0	90	0	90	GBP	96.02 %	111'721.19	0.07	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	200	0	0	200	GBP	160.84 %	415'867.90	0.24	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	80	0	0	80	GBP	110.32 %	114'097.36	0.07	a)
GB00BY5F581	1.5000 % UKT 1 1/2 01/22/21	200	0	200	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	50	70	0	120	GBP	168.75 %	261'796.65	0.15	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	80	0	0	80	GBP	108.97 %	112'697.00	0.07	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	50	60	0	110	GBP	118.10 %	167'947.65	0.10	a)
GB								9'115'252.09	5.32	
IE00B4S3JD47	3.9000 % IRISH 3.9 03/20/23	180	0	50	130	EUR	111.09 %	169'350.47	0.10	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	140	0	0	140	EUR	126.69 %	207'988.09	0.12	a)
IE00B60Z6194	5.0000 % IRISH 5 10/18/20	100	0	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IE00BDHDPR44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	0	100	0	100	EUR	109.33 %	128'205.73	0.07	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	0	50	0	50	EUR	116.88 %	68'529.62	0.04	a)
IE00BH3SQB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	0	15	0	15	EUR	129.21 %	22'727.70	0.01	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	150	0	0	150	EUR	125.27 %	220'346.63	0.13	a)
IE00BKFCV345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	0	15	0	15	EUR	104.78 %	18'430.53	0.01	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	90	0	0	90	EUR	139.52 %	147'247.21	0.09	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	0	80	0	80	EUR	108.32 %	101'617.08	0.06	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	0	40	0	40	EUR	125.46 %	58'848.22	0.03	a)
IE								1'143'291.28	0.67	
IL0011232720	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/22 0122	0	300	0	300	ILS	107.28 %	94'095.57	0.05	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	0	250	0	250	ILS	174.09 %	127'246.41	0.07	a)
IL0011267478	4.2500 % ILGOV 4 1/4 03/31/23 0323	0	300	0	300	ILS	110.26 %	96'710.09	0.06	a)
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	0	300	0	300	ILS	107.03 %	93'874.36	0.05	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	0	300	0	300	ILS	109.98 %	96'462.82	0.06	a)
IL								508'389.25	0.30	
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27	0	140	0	140	EUR	140.78 %	231'120.76	0.13	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29	800	0	160	640	EUR	139.48 %	1'046'798.70	0.61	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31	0	90	0	90	EUR	151.21 %	159'586.22	0.09	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33	1'010	0	0	1'010	EUR	154.18 %	1'826'116.52	1.07	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37	0	80	0	80	EUR	139.01 %	130'404.47	0.08	a)
IT0004009673	3.7500 % BTPS 3 3/4 08/01/21	200	0	200	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39	0	85	0	85	EUR	158.91 %	158'396.06	0.09	a)
IT0004356843	4.7500 % BTPS 4 3/4 08/01/23	1'375	0	255	1'120	EUR	113.60 %	1'492'004.51	0.87	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25	0	160	0	160	EUR	121.09 %	227'191.67	0.13	a)
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40	0	140	0	140	EUR	160.01 %	262'685.62	0.15	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26	0	80	0	80	EUR	122.14 %	114'584.00	0.07	a)
IT0004759673	5.0000 % BTPS 5 03/01/22	0	120	0	120	EUR	107.45 %	151'205.05	0.09	a)
IT0004801541	5.5000 % BTPS 5 1/2 09/01/22	0	80	0	80	EUR	110.92 %	104'053.47	0.06	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28	0	180	0	180	EUR	131.47 %	277'494.87	0.16	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44	120	0	0	120	EUR	161.46 %	227'202.54	0.13	a)
IT0004953417	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/24	150	100	0	250	EUR	115.16 %	337'618.06	0.20	a)
IT0005001547	3.7500 % BTPS 3 3/4 09/01/24	0	60	0	60	EUR	114.10 %	80'282.28	0.05	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24	200	0	0	200	EUR	109.68 %	257'234.26	0.15	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25	200	0	0	200	EUR	105.88 %	248'327.87	0.14	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25	350	0	0	350	EUR	108.72 %	446'208.45	0.26	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47	350	100	100	350	EUR	121.64 %	499'239.25	0.29	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26	300	0	0	300	EUR	106.85 %	375'875.62	0.22	a)
IT0005172322	0.9500 % BTPS 0.95 03/15/23	300	0	0	300	EUR	102.56 %	360'801.21	0.21	a)
IT0005175598	0.4500 % BTPS 0.45 06/01/21	230	0	230	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36	200	70	140	130	EUR	114.30 %	174'239.09	0.10	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26	350	0	0	350	EUR	104.96 %	430'769.41	0.25	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0005216491	0.3500 % BTPS 0.35 11/01/21	100	320	0	420	EUR	100.68 %	495'866.49	0.29	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67	60	15	0	75	EUR	124.15 %	109'187.81	0.06	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27	0	80	0	80	EUR	111.04 %	104'169.85	0.06	a)
IT0005244782	1.2000 % BTPS 1.2 04/01/22	235	0	0	235	EUR	102.12 %	281'420.52	0.16	a)
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48	0	25	0	25	EUR	138.27 %	40'534.80	0.02	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27	200	0	0	200	EUR	110.14 %	258'304.49	0.15	a)
IT0005277444	0.9000 % BTPS 0.9 08/01/22	0	190	0	190	EUR	102.03 %	227'320.94	0.13	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24	200	0	0	200	EUR	105.39 %	247'177.10	0.14	a)
IT0005285041	0.2000 % BTPS 0.2 10/15/20	500	0	500	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38	400	0	120	280	EUR	124.66 %	409'322.29	0.24	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28	200	0	0	200	EUR	110.04 %	258'079.08	0.15	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25	100	0	0	100	EUR	105.59 %	123'814.23	0.07	a)
IT0005330961	0.0500 % BTPS 0.05 04/15/21	480	0	480	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49	0	70	0	70	EUR	148.03 %	121'508.65	0.07	a)
IT0005366007	1.0000 % BTPS 1 07/15/22	0	100	0	100	EUR	102.16 %	119'802.77	0.07	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40	0	100	0	100	EUR	127.16 %	149'118.47	0.09	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25	0	100	0	100	EUR	100.77 %	118'169.20	0.07	a)
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27	0	60	0	60	EUR	102.34 %	72'002.79	0.04	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	0	100	0	100	EUR	116.26 %	136'330.23	0.08	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36	0	60	0	60	EUR	103.08 %	72'527.11	0.04	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30	0	30	0	30	EUR	107.60 %	37'853.27	0.02	a)
IT								13'001'950.05	7.59	
JP1024061KB7	0.1000 % JGB 0.1 11/01/21 406	0	45'000	45'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1024091L27	0.1000 % JGB 0.1 02/01/22 409	0	30'000	0	30'000	JPY	100.34 %	285'251.64	0.17	a)
JP1024121L54	0.1000 % JGB 0.1 05/01/22 412	0	10'000	0	10'000	JPY	100.47 %	95'200.43	0.06	a)
JP1024141L76	0.1000 % JGB 0.1 07/01/22 414	0	30'000	0	30'000	JPY	100.46 %	285'584.24	0.17	a)
JP1024151L81	0.1000 % JGB 0.1 08/01/22 415	0	9'000	0	9'000	JPY	100.46 %	85'677.83	0.05	a)
JP1051251F99	0.1000 % JGB 0.1 09/20/20 125	20'000	0	20'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1051311H38	0.1000 % JGB 0.1 03/20/22 131	30'000	0	0	30'000	JPY	100.36 %	285'299.96	0.17	a)
JP1051321H69	0.1000 % JGB 0.1 06/20/22 132	15'000	10'000	15'000	10'000	JPY	100.42 %	95'154.95	0.06	a)
JP1051331H91	0.1000 % JGB 0.1 09/20/22 133	30'000	0	0	30'000	JPY	100.47 %	285'626.88	0.17	a)
JP1051351J37	0.1000 % JGB 0.1 03/20/23 135	60'000	0	0	60'000	JPY	100.58 %	571'850.76	0.33	a)
JP1051381K12	0.1000 % JGB 0.1 12/20/23 138	0	10'000	0	10'000	JPY	100.74 %	95'458.18	0.06	a)
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	15'000	0	0	15'000	JPY	100.80 %	143'269.71	0.08	a)
JP1051411KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/24 141	0	30'000	0	30'000	JPY	100.91 %	286'874.87	0.17	a)
JP1103151B69	1.2000 % JGB 1.2 06/20/21 315	417'000	0	417'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1103191BC3	1.1000 % JGB 1.1 12/20/21 319	0	26'000	0	26'000	JPY	101.52 %	250'127.78	0.15	a)
JP1103201C19	1.0000 % JGB 1 12/20/21 320	0	50'000	0	50'000	JPY	101.40 %	480'432.19	0.28	a)
JP1103211C33	1.0000 % JGB 1 03/20/22 321	0	10'000	0	10'000	JPY	101.68 %	96'352.71	0.06	a)
JP1103221C56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/22 322	0	10'000	0	10'000	JPY	101.53 %	96'213.42	0.06	a)
JP1103231C62	0.9000 % JGB 0.9 06/20/22 323	0	15'000	0	15'000	JPY	101.80 %	144'691.11	0.08	a)
JP1103241C78	0.8000 % JGB 0.8 06/20/22 324	30'000	0	0	30'000	JPY	101.62 %	288'893.25	0.17	a)
JP1103251C91	0.8000 % JGB 0.8 09/20/22 325	10'000	15'000	0	25'000	JPY	101.86 %	241'298.72	0.14	a)
JP1103271D13	0.8000 % JGB 0.8 12/20/22 327	30'000	0	0	30'000	JPY	102.06 %	290'144.08	0.17	a)
JP1103291D68	0.8000 % JGB 0.8 06/20/23 329	10'000	0	0	10'000	JPY	102.54 %	97'166.70	0.06	a)
JP1103311DB5	0.6000 % JGB 0.6 09/20/23 331	212'000	0	20'000	192'000	JPY	102.17 %	1'858'887.08	1.09	a)
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	0	15'000	0	15'000	JPY	102.51 %	145'705.99	0.09	a)
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	127'000	0	0	127'000	JPY	102.46 %	1'232'994.14	0.72	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	0	10'000	0	10'000	JPY	101.16 %	95'859.01	0.06	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	0	10'000	0	10'000	JPY	101.21 %	95'904.50	0.06	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	34'000	0	34'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1103451GC0	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	32'500	0	0	32'500	JPY	101.36 %	312'142.33	0.18	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	60'500	0	0	60'500	JPY	101.42 %	581'454.80	0.34	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	0	10'000	0	10'000	JPY	101.46 %	96'139.50	0.06	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	30'000	0	0	30'000	JPY	101.45 %	288'390.08	0.17	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	35'000	0	0	35'000	JPY	101.43 %	336'385.45	0.20	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	15'000	0	0	15'000	JPY	101.37 %	144'089.86	0.08	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	0	10'000	0	10'000	JPY	101.31 %	96'002.10	0.06	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	0	20'000	0	20'000	JPY	101.24 %	191'871.54	0.11	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	0	20'000	0	20'000	JPY	101.17 %	191'727.50	0.11	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	0	10'000	0	10'000	JPY	101.05 %	95'751.94	0.06	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	30'000	0	30'000	JPY	100.92 %	286'894.77	0.17	a)
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	0	12'000	0	12'000	JPY	100.79 %	114'604.40	0.07	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	30'000	0	0	30'000	JPY	113.26 %	321'972.01	0.19	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	0	10'000	0	10'000	JPY	113.88 %	107'907.72	0.06	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	35'000	0	0	35'000	JPY	119.26 %	395'543.51	0.23	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	0	10'000	0	10'000	JPY	116.18 %	110'090.04	0.06	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	12'000	0	0	12'000	JPY	118.24 %	134'451.65	0.08	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	35'000	0	0	35'000	JPY	119.06 %	394'866.93	0.23	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	0	15'000	0	15'000	JPY	119.51 %	169'869.73	0.10	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	20'000	0	0	20'000	JPY	119.85 %	227'133.56	0.13	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	10'000	0	0	10'000	JPY	115.34 %	109'291.22	0.06	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	18'000	15'000	18'000	15'000	JPY	121.01 %	172'004.67	0.10	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	45'500	0	0	45'500	JPY	119.60 %	515'659.57	0.30	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	54'500	0	20'000	34'500	JPY	118.81 %	388'428.29	0.23	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	53'000	0	0	53'000	JPY	119.08 %	598'056.86	0.35	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	10'000	0	0	10'000	JPY	117.07 %	110'936.25	0.06	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	55'000	0	20'000	35'000	JPY	116.13 %	385'142.68	0.22	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	58'500	0	0	58'500	JPY	118.67 %	657'824.38	0.38	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	51'000	0	20'000	31'000	JPY	118.89 %	349'234.02	0.20	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	10'000	0	0	10'000	JPY	118.01 %	111'824.14	0.07	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	36'500	0	0	36'500	JPY	119.44 %	413'124.87	0.24	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	10'000	0	0	10'000	JPY	119.65 %	113'376.31	0.07	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	10'000	0	0	10'000	JPY	117.51 %	111'354.14	0.07	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	44'500	0	0	44'500	JPY	116.44 %	491'009.70	0.29	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	0	10'000	0	10'000	JPY	113.82 %	107'854.66	0.06	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	10'000	0	0	10'000	JPY	115.28 %	109'241.94	0.06	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	0	15'000	0	15'000	JPY	113.90 %	161'895.70	0.09	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	32'000	0	0	32'000	JPY	111.05 %	336'747.52	0.20	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	0	15'000	0	15'000	JPY	102.02 %	145'013.76	0.08	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	0	10'000	0	10'000	JPY	98.78 %	93'599.94	0.05	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	18'000	0	0	18'000	JPY	103.22 %	176'065.04	0.10	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	0	20'000	0	20'000	JPY	104.86 %	198'734.04	0.12	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	15'000	0	0	15'000	JPY	106.38 %	151'211.06	0.09	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	0	15'000	0	15'000	JPY	104.76 %	148'902.71	0.09	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	10'000	0	0	10'000	JPY	104.53 %	99'053.37	0.06	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	0	15'000	0	15'000	JPY	104.47 %	148'494.77	0.09	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	10'000	0	0	10'000	JPY	102.48 %	97'106.05	0.06	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	0	10'000	0	10'000	JPY	100.14 %	94'891.52	0.06	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	0	10'000	0	10'000	JPY	100.01 %	94'764.54	0.06	a)
JP13000611B1	2.4000 % JGB 2.4 11/20/31 6	12'000	0	0	12'000	JPY	125.62 %	142'844.71	0.08	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	39'000	0	0	39'000	JPY	129.39 %	478'159.37	0.28	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	0	10'000	0	10'000	JPY	130.54 %	123'694.70	0.07	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	37'500	0	10'000	27'500	JPY	129.43 %	337'286.14	0.20	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	0	10'000	0	10'000	JPY	133.82 %	126'811.35	0.07	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	0	10'000	0	10'000	JPY	133.71 %	126'706.17	0.07	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	0	15'000	0	15'000	JPY	136.67 %	194'256.64	0.11	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	201'000	0	35'000	166'000	JPY	133.45 %	2'099'122.50	1.23	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	0	20'000	0	20'000	JPY	130.63 %	247'563.77	0.14	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	10'000	10'000	0	20'000	JPY	134.89 %	255'637.30	0.15	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	25'000	0	0	25'000	JPY	131.54 %	311'615.23	0.18	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	20'000	0	0	20'000	JPY	131.97 %	250'109.02	0.15	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	34'500	0	0	34'500	JPY	130.38 %	426'226.93	0.25	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	20'000	0	0	20'000	JPY	128.68 %	243'881.40	0.14	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	10'000	0	0	10'000	JPY	130.92 %	124'058.58	0.07	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	35'000	0	0	35'000	JPY	127.04 %	421'339.97	0.25	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	10'000	0	0	10'000	JPY	127.30 %	120'628.28	0.07	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	17'000	0	0	17'000	JPY	127.43 %	205'274.27	0.12	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	10'000	0	0	10'000	JPY	123.25 %	116'790.51	0.07	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	0	10'000	0	10'000	JPY	125.55 %	118'973.77	0.07	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	20'000	0	0	20'000	JPY	106.88 %	202'556.65	0.12	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	9'500	0	0	9'500	JPY	99.42 %	89'496.08	0.05	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	7'500	0	0	7'500	JPY	101.83 %	72'372.56	0.04	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	10'000	0	0	10'000	JPY	106.63 %	101'040.48	0.06	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	10'000	0	0	10'000	JPY	106.56 %	100'975.10	0.06	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	15'000	0	0	15'000	JPY	106.49 %	151'365.99	0.09	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	15'000	0	0	15'000	JPY	106.42 %	151'260.80	0.09	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	10'000	0	0	10'000	JPY	106.34 %	100'766.62	0.06	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	0	15'000	0	15'000	JPY	103.85 %	147'616.34	0.09	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	0	8'000	0	8'000	JPY	108.88 %	82'537.30	0.05	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	0	20'000	0	20'000	JPY	103.41 %	195'986.01	0.11	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	0	10'000	0	10'000	JPY	98.17 %	93'023.80	0.05	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	0	7'000	0	7'000	JPY	95.34 %	63'239.47	0.04	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	0	10'000	0	10'000	JPY	147.12 %	139'408.72	0.08	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	0	10'000	0	10'000	JPY	142.90 %	135'411.75	0.08	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	103'000	0	30'000	73'000	JPY	143.49 %	992'587.11	0.58	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	0	12'000	0	12'000	JPY	140.01 %	159'207.84	0.09	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	8'000	0	0	8'000	JPY	138.18 %	104'752.79	0.06	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	0	10'000	0	10'000	JPY	132.97 %	126'004.00	0.07	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	15'000	0	0	15'000	JPY	124.59 %	177'087.59	0.10	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	0	10'000	0	10'000	JPY	93.21 %	88'320.87	0.05	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	20'000	0	0	20'000	JPY	109.36 %	207'256.74	0.12	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	10'000	0	0	10'000	JPY	106.06 %	100'498.45	0.06	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	10'000	10'000	0	20'000	JPY	96.11 %	182'145.39	0.11	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	0	10'000	0	10'000	JPY	95.92 %	90'891.70	0.05	a)
JP								29'744'844.03	17.37	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	0	20'000	0	20'000	MXN	109.72 %	99'403.07	0.06	a)
MX0MGO0000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M 20	0	20'000	0	20'000	MXN	119.00 %	107'812.30	0.06	a)
MX0MGO00000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M 20	50'000	0	0	50'000	MXN	111.34 %	252'183.87	0.15	a)
MX0MGO00000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M 20	0	10'000	0	10'000	MXN	118.45 %	53'655.99	0.03	a)
MX0MGO00000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M 30	15'000	0	0	15'000	MXN	117.68 %	79'958.58	0.05	a)
MX0MGO00000N7	6.5000 % MBONO 6 1/2 06/10/21 M	62'600	0	62'600	0	MXN	0.00 %	0.00	0.00	
MX0MGO00000Q0	6.5000 % MBONO 6 1/2 06/09/22 M	0	43'000	0	43'000	MXN	103.37 %	201'345.98	0.12	a)
MX0MGO00000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	17'500	0	0	17'500	MXN	108.65 %	86'129.50	0.05	a)
MX0MGO00000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	23'100	0	0	23'100	MXN	112.44 %	117'654.55	0.07	a)
MX0MGO0000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	3'400	0	0	3'400	MXN	110.93 %	17'084.64	0.01	a)
MX								1'015'228.48	0.59	
MYBMN1300033	3.4800 % MGS 3.48 03/15/23 0313	0	660	0	660	MYR	103.51 %	164'402.02	0.10	a)
MYBMO1100019	4.1600 % MGS 4.16 07/15/21 0111	1'280	0	1'280	0	MYR	0.00 %	0.00	0.00	
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	500	0	0	500	MYR	107.94 %	129'879.68	0.08	a)
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	0	300	0	300	MYR	108.38 %	78'246.18	0.05	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	0	400	0	400	MYR	116.01 %	111'672.72	0.07	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	500	0	0	500	MYR	114.25 %	137'472.03	0.08	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	0	300	0	300	MYR	116.69 %	84'239.68	0.05	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	140	0	0	140	MYR	113.68 %	38'298.45	0.02	a)
MY								744'210.76	0.43	
NL0000102077	7.5000 % NETHER 7 1/2 01/15/23	0	30	0	30	EUR	118.92 %	41'835.43	0.02	a)
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	240	0	40	200	EUR	170.22 %	399'216.67	0.23	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
NL0000102275	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/23	0	80	50	30	EUR	110.22 %	38'774.82	0.02	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	140	0	0	140	EUR	144.89 %	237'867.19	0.14	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	0	110	0	110	EUR	184.41 %	237'873.05	0.14	a)
NL0009712470	3.2500 % NETHER 3 1/4 07/15/21	100	0	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
NL0010060257	2.2500 % NETHER 2 1/4 07/15/22	100	0	0	100	EUR	105.23 %	123'397.87	0.07	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	0	30	0	30	EUR	135.50 %	47'668.19	0.03	a)
NL0010418810	1.7500 % NETHER 1 3/4 07/15/23	200	0	0	200	EUR	106.82 %	250'524.76	0.15	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	120	0	0	120	EUR	175.42 %	246'847.33	0.14	a)
NL0010733424	2.0000 % NETHER 2 07/15/24	170	0	0	170	EUR	110.28 %	219'843.57	0.13	a)
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	100	0	0	100	EUR	104.39 %	122'412.84	0.07	a)
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	150	0	0	150	EUR	106.61 %	187'524.19	0.11	a)
NL0011896857	0.0000 % NETHER 0 01/15/22	100	50	50	100	EUR	100.80 %	118'203.03	0.07	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	80	0	0	80	EUR	109.06 %	102'311.29	0.06	a)
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	100	0	0	100	EUR	110.10 %	129'108.67	0.08	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	0	70	0	70	EUR	106.50 %	87'420.99	0.05	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	50	0	50	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	0	70	0	70	EUR	104.09 %	85'442.73	0.05	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	0	40	0	40	EUR	100.54 %	47'158.32	0.03	a)
NL								2'723'430.94	1.59	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	1'850	0	0	1'850	NOK	109.49 %	216'485.16	0.13	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	0	500	0	500	NOK	111.18 %	59'412.61	0.03	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	0	230	0	230	NOK	107.20 %	26'351.70	0.02	a)
NO								302'249.47	0.18	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	600	0	0	600	PLN	137.47 %	213'332.99	0.12	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	620	0	400	220	PLN	112.55 %	64'042.31	0.04	a)
PL0000109153	1.7500 % POLGB 1 3/4 07/25/21 0721	600	0	600	0	PLN	0.00 %	0.00	0.00	
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	0	450	0	450	PLN	109.86 %	127'864.78	0.07	a)
PL0000110151	2.5000 % POLGB 2 1/2 01/25/23 0123	600	0	0	600	PLN	105.59 %	163'859.97	0.10	a)
PL0000112165	0.0000 % POLGB 0 07/25/22 0722	0	650	0	650	PLN	99.83 %	167'831.42	0.10	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	0	550	0	550	PLN	100.81 %	143'405.28	0.08	a)
PL								880'336.75	0.51	
SE0001149311	5.0000 % SGB 5 12/01/20 #1047 1047	1'550	0	1'550	0	SEK	0.00 %	0.00	0.00	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	750	0	0	750	SEK	156.79 %	131'390.78	0.08	a)
SE0003784461	3.5000 % SGB 3 1/2 06/01/22 #1054 1054	0	800	0	800	SEK	106.45 %	95'150.83	0.06	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	1'000	0	0	1'000	SEK	105.79 %	118'195.53	0.07	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	0	500	0	500	SEK	107.67 %	60'149.16	0.04	a)
SE								404'886.30	0.24	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	100	0	0	100	SGD	108.90 %	79'774.38	0.05	a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	40	0	0	40	SGD	131.68 %	38'584.72	0.02	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	0	70	0	70	SGD	115.54 %	59'246.94	0.03	a)
SG31B0000009	1.2500 % SIGB 1 1/4 10/01/21	100	0	0	100	SGD	101.00 %	73'987.25	0.04	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	40	0	0	40	SGD	127.40 %	37'330.60	0.02	a)
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	120	0	0	120	SGD	106.74 %	93'830.49	0.05	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	50	0	0	50	SGD	117.23 %	42'938.25	0.03	a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	165	0	0	165	SGD	117.80 %	142'385.17	0.08	a)
SG7S30941627	3.0000 % SIGB 3 09/01/24	40	0	0	40	SGD	110.21 %	32'293.61	0.02	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	0	35	0	35	SGD	116.00 %	29'741.41	0.02	a)
SG								630'112.82	0.37	
US912810EQ77	6.2500 % T 6 1/4 08/15/23	900	0	600	300	USD	117.42 %	352'265.64	0.21	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	1'425	0	700	725	USD	139.81 %	1'013'640.63	0.59	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	0	80	0	80	USD	152.69 %	122'150.00	0.07	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	325	0	150	175	USD	151.48 %	265'097.67	0.15	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	450	0	150	300	USD	153.58 %	460'734.36	0.27	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	0	100	0	100	USD	156.41 %	156'406.25	0.09	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	100	0	0	100	USD	161.20 %	161'203.12	0.09	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	150	100	150	100	USD	157.16 %	157'156.25	0.09	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	550	0	100	450	USD	165.17 %	743'273.46	0.43	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	0	100	0	100	USD	135.28 %	135'281.25	0.08	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	0	100	0	100	USD	135.66 %	135'656.25	0.08	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	250	0	0	250	USD	128.34 %	320'859.38	0.19	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	250	0	0	250	USD	128.23 %	320'585.95	0.19	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	175	0	0	175	USD	135.67 %	237'425.79	0.14	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	230	0	0	230	USD	130.78 %	300'796.88	0.18	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	180	0	0	180	USD	146.02 %	262'828.12	0.15	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	290	0	100	190	USD	148.77 %	282'654.68	0.17	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	290	0	0	290	USD	146.38 %	424'487.50	0.25	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	290	0	100	190	USD	141.39 %	268'642.18	0.16	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	290	0	0	290	USD	136.31 %	395'306.25	0.23	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	280	0	150	130	USD	133.84 %	173'996.88	0.10	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	180	0	0	180	USD	123.30 %	221'934.38	0.13	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	280	0	80	200	USD	134.11 %	268'218.76	0.16	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	280	0	70	210	USD	131.63 %	276'412.50	0.16	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	280	0	200	80	USD	134.59 %	107'675.00	0.06	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	280	0	0	280	USD	123.69 %	346'325.00	0.20	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	280	0	100	180	USD	123.77 %	222'778.12	0.13	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	230	0	0	230	USD	118.33 %	272'154.68	0.16	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	300	0	60	240	USD	132.41 %	317'775.00	0.19	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	250	0	0	250	USD	135.55 %	338'867.20	0.20	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	400	0	200	200	USD	135.72 %	271'437.50	0.16	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	270	0	0	270	USD	130.06 %	351'168.75	0.21	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	300	0	0	300	USD	130.22 %	390'656.25	0.23	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	450	0	190	260	USD	136.17 %	354'046.89	0.21	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	260	0	0	260	USD	139.31 %	362'212.50	0.21	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	200	0	0	200	USD	136.56 %	273'125.00	0.16	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	360	0	0	360	USD	145.84 %	525'037.50	0.31	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	330	0	0	330	USD	136.98 %	452'048.45	0.26	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	250	100	0	350	USD	134.17 %	469'601.58	0.27	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	160	200	0	360	USD	119.20 %	429'131.23	0.25	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	0	340	0	340	USD	122.42 %	416'234.39	0.24	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	0	380	0	380	USD	113.41 %	430'943.75	0.25	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	0	380	0	380	USD	95.06 %	361'237.50	0.21	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	0	220	0	220	USD	98.14 %	215'909.36	0.13	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	0	80	0	80	USD	98.33 %	78'662.50	0.05	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	0	360	0	360	USD	98.64 %	355'106.23	0.21	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	600	0	0	600	USD	106.63 %	639'750.00	0.37	a)
US9128282P40	1.8750 % T 1 7/8 07/31/22	250	0	0	250	USD	103.19 %	257'968.75	0.15	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	0	400	0	400	USD	112.20 %	448'812.48	0.26	a)
US9128282S88	1.6250 % T 1 5/8 08/31/22	650	0	0	650	USD	102.86 %	668'585.97	0.39	a)
US9128282W90	1.8750 % T 1 7/8 09/30/22	500	0	0	500	USD	103.48 %	517'421.90	0.30	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	0	200	0	200	USD	107.63 %	215'250.00	0.13	a)
US9128283C28	2.0000 % T 2 10/31/22	500	0	0	500	USD	103.88 %	519'375.00	0.30	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	0	220	0	220	USD	109.78 %	241'518.75	0.14	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	600	0	0	600	USD	116.38 %	698'250.00	0.41	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	0	200	0	200	USD	111.03 %	222'062.50	0.13	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	300	250	300	250	USD	117.70 %	294'257.80	0.17	a)
US9128284T44	2.6250 % T 2 5/8 06/15/21	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US9128284U17	2.6250 % T 2 5/8 06/30/23	500	0	0	500	USD	106.78 %	533'906.25	0.31	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	650	0	0	650	USD	118.13 %	767'812.50	0.45	a)
US9128284X55	2.7500 % T 2 3/4 08/31/23	250	0	0	250	USD	107.55 %	268'867.20	0.16	a)
US9128284Y39	2.6250 % T 2 5/8 08/31/20	1'000	0	1'000	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	400	0	0	400	USD	113.50	454'000.00	0.27	a)
US9128285D82	2.8750 % T 2 7/8 09/30/23	400	0	0	400	USD	108.13	432'500.00	0.25	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	200	0	0	200	USD	113.69	227'375.00	0.13	a)
US9128285K26	2.8750 % T 2 7/8 10/31/23	0	250	0	250	USD	108.31	270'781.25	0.16	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	350	0	0	350	USD	120.50	421'750.00	0.25	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	250	0	0	250	USD	112.09	280'234.38	0.16	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	200	0	0	200	USD	112.27	224'531.24	0.13	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	550	0	0	550	USD	116.88	642'812.50	0.38	a)
US9128286C90	2.5000 % T 2 1/2 02/15/22	250	0	0	250	USD	103.25	258'125.00	0.15	a)
US9128286D73	2.5000 % T 2 1/2 02/28/21	500	0	500	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	200	0	0	200	USD	111.72	223'437.50	0.13	a)
US9128286H87	2.3750 % T 2 3/8 03/15/22	150	0	0	150	USD	103.27	154'898.43	0.09	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	200	0	0	200	USD	110.50	221'000.00	0.13	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	250	0	0	250	USD	107.38	268'437.50	0.16	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	0	100	0	100	USD	111.31	111'312.50	0.06	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	500	0	0	500	USD	115.13	575'625.00	0.34	a)
US9128286U98	2.1250 % T 2 1/8 05/15/22	0	150	0	150	USD	103.22	154'828.13	0.09	a)
US9128286V71	2.1250 % T 2 1/8 05/31/21	300	0	300	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	100	0	0	100	USD	110.02	110'015.62	0.06	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	300	0	0	300	USD	105.81	317'437.50	0.19	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	250	0	0	250	USD	108.69	271'718.75	0.16	a)
US9128287C81	1.7500 % T 1 3/4 07/15/22	0	100	0	100	USD	102.89	102'890.62	0.06	a)
US912828A420	2.0000 % T 2 11/30/20	1'000	0	1'000	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828B667	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	1'010	0	0	1'010	USD	108.67	1'097'585.99	0.64	a)
US912828D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	900	0	0	900	USD	108.38	975'375.00	0.57	a)
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	1'205	0	0	1'205	USD	108.31	1'305'165.63	0.76	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	200	250	0	450	USD	107.66	484'453.13	0.28	a)
US912828J439	1.7500 % T 1 3/4 02/28/22	0	100	0	100	USD	102.28	102'281.25	0.06	a)
US912828J769	1.7500 % T 1 3/4 03/31/22	250	0	0	250	USD	102.42	256'054.70	0.15	a)
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	0	300	0	300	USD	108.36	325'078.14	0.19	a)
US912828L575	1.7500 % T 1 3/4 09/30/22	0	200	0	200	USD	103.22	206'437.50	0.12	a)
US912828L658	1.3750 % T 1 3/8 09/30/20	600	0	600	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828L997	1.3750 % T 1 3/8 10/31/20	600	0	600	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828M490	1.8750 % T 1 7/8 10/31/22	0	100	0	100	USD	103.61	103'609.38	0.06	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	600	0	100	500	USD	109.95	549'765.60	0.32	a)
US912828M805	2.0000 % T 2 11/30/22	800	150	200	750	USD	104.03	780'234.38	0.46	a)
US912828N308	2.1250 % T 2 1/8 12/31/22	0	550	0	550	USD	104.47	574'578.13	0.34	a)
US912828N480	1.7500 % T 1 3/4 12/31/20	500	0	500	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828N894	1.3750 % T 1 3/8 01/31/21	1'100	0	1'100	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828P386	1.7500 % T 1 3/4 01/31/23	500	0	0	500	USD	103.73	518'671.90	0.30	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	350	50	0	400	USD	106.98	427'937.52	0.25	a)
US912828P790	1.5000 % T 1 1/2 02/28/23	0	150	0	150	USD	103.28	154'921.88	0.09	a)
US912828PC88	2.6250 % T 2 5/8 11/15/20	0	220	220	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828PCXX	2.6250 % T 2 5/8 11/15/20	220	0	220	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828Q293	1.5000 % T 1 1/2 03/31/23	750	0	150	600	USD	103.38	620'250.00	0.36	a)
US912828Q376	1.2500 % T 1 1/4 03/31/21	1'200	0	1'200	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828QN35	3.1250 % T 3 1/8 05/15/21	1'050	0	1'050	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828R283	1.6250 % T 1 5/8 04/30/23	0	200	0	200	USD	103.81	207'625.00	0.12	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	600	0	0	600	USD	107.16	642'937.50	0.38	a)
US912828R697	1.6250 % T 1 5/8 05/31/23	0	150	0	150	USD	103.94	155'906.25	0.09	a)
US912828RR30	2.0000 % T 2 11/15/21	4'850	0	900	3'950	USD	102.09	4'032'703.13	2.35	a)
US912828S273	1.1250 % T 1 1/8 06/30/21	340	0	340	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828S760	1.1250 % T 1 1/8 07/31/21	600	0	600	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828SV33	1.7500 % T 1 3/4 05/15/22	0	200	0	200	USD	102.61	205'218.76	0.12	a)
US912828TJ95	1.6250 % T 1 5/8 08/15/22	400	0	150	250	USD	102.80	256'992.20	0.15	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	500	0	0	500	USD	109.80	548'984.40	0.32	a)
US912828U576	2.1250 % T 2 1/8 11/30/23	480	0	0	480	USD	106.17	509'625.02	0.30	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912828UN88	2.0000 % T 2 02/15/23	650	0	0	650	USD	104.41	678'640.63	0.40	a)
US912828V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	200	0	0	200	USD	106.73	213'468.76	0.12	a)
US912828V723	1.8750 % T 1 7/8 01/31/22	250	0	0	250	USD	102.33	255'820.30	0.15	a)
US912828V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	530	0	0	530	USD	106.88	566'437.50	0.33	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	300	100	0	400	USD	111.64	446'562.48	0.26	a)
US912828VB32	1.7500 % T 1 3/4 05/15/23	950	0	250	700	USD	104.20	729'421.84	0.43	a)
US912828W556	1.8750 % T 1 7/8 02/28/22	400	0	0	400	USD	102.45	409'812.48	0.24	a)
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	300	150	0	450	USD	106.78	480'515.63	0.28	a)
US912828W895	1.8750 % T 1 7/8 03/31/22	200	0	0	200	USD	102.59	205'187.50	0.12	a)
US912828WE61	2.7500 % T 2 3/4 11/15/23	840	0	0	840	USD	108.05	907'593.79	0.53	a)
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	450	0	0	450	USD	108.34	487'546.88	0.28	a)
US912828X471	1.8750 % T 1 7/8 04/30/22	1'000	0	0	1'000	USD	102.75	1'027'500.00	0.60	a)
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	0	150	0	150	USD	106.47	159'703.13	0.09	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	0	110	0	110	USD	112.75	124'025.00	0.07	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	3'100	0	1'250	1'850	USD	108.61	2'009'273.53	1.17	a)
US912828XD79	1.8750 % T 1 7/8 05/31/22	250	250	0	500	USD	102.89	514'453.10	0.30	a)
US912828XG01	2.1250 % T 2 1/8 06/30/22	850	0	0	850	USD	103.47	879'484.38	0.51	a)
US912828XQ82	2.0000 % T 2 07/31/22	150	0	0	150	USD	103.41	155'109.38	0.09	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	400	0	0	400	USD	106.61	426'437.52	0.25	a)
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	0	120	0	120	USD	106.73	128'081.26	0.07	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	200	300	0	500	USD	108.92	544'609.40	0.32	a)
US912828YC87	1.5000 % T 1 1/2 08/31/21	500	0	0	500	USD	101.25	506'250.00	0.30	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	200	0	0	200	USD	105.92	211'843.76	0.12	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	250	0	0	250	USD	104.06	260'156.25	0.15	a)
US912828YF19	1.5000 % T 1 1/2 09/15/22	0	250	0	250	USD	102.67	256'679.70	0.15	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	0	400	0	400	USD	107.44	429'750.00	0.25	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	0	250	0	250	USD	105.13	262'812.50	0.15	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	0	450	0	450	USD	110.16	495'703.13	0.29	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	0	200	0	200	USD	107.55	215'093.76	0.13	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	0	120	0	120	USD	105.30	126'356.26	0.07	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	0	140	0	140	USD	108.41	151'768.75	0.09	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	0	450	0	450	USD	106.44	478'968.75	0.28	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	0	250	0	250	USD	104.92	262'304.70	0.15	a)
US912828Z609	1.3750 % T 1 3/8 01/31/22	0	450	0	450	USD	101.66	457'453.13	0.27	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	0	140	0	140	USD	106.89	149'646.87	0.09	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	0	200	0	200	USD	107.94	215'875.00	0.13	a)
US912828ZA13	1.1250 % T 1 1/8 02/28/22	0	250	0	250	USD	101.41	253'515.63	0.15	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	0	100	0	100	USD	104.55	104'546.88	0.06	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	0	300	0	300	USD	103.92	311'765.64	0.18	a)
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	0	220	0	220	USD	101.33	222'921.86	0.13	a)
US912828ZG82	0.3750 % T 0 3/8 03/31/22	0	150	0	150	USD	100.36	150'539.07	0.09	a)
US912828ZH65	0.2500 % T 0 1/4 04/15/23	0	300	0	300	USD	100.28	300'843.75	0.18	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	0	200	0	200	USD	100.50	201'000.00	0.12	a)
US912828ZP81	0.1250 % T 0 1/8 05/15/23	0	100	0	100	USD	99.94	99'937.50	0.06	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	0	500	0	500	USD	99.72	498'593.75	0.29	a)
US912828ZR48	0.1250 % T 0 1/8 05/31/22	0	150	0	150	USD	99.98	149'976.57	0.09	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	0	250	0	250	USD	100.44	251'093.75	0.15	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	0	300	0	300	USD	100.39	301'171.86	0.18	a)
US912828ZX16	0.1250 % T 0 1/8 06/30/22	0	150	0	150	USD	100.00	150'000.00	0.09	a)
US912828CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	0	350	0	350	USD	99.92	349'726.58	0.20	a)
US912828CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	0	300	0	300	USD	99.52	298'546.86	0.17	a)
US912828CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	0	380	0	380	USD	99.50	378'100.00	0.22	a)
US912828CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	0	50	0	50	USD	100.28	50'140.50	0.03	a)
US912828CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	0	200	0	200	USD	99.92	199'844.00	0.12	a)
US								61'961'702.17	36.18	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2019	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2020	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ZAG00016320	10.5000 % SAGB 10 1/2 12/21/26 #R186 R186 2'350		0	2'350	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZAG000096165	7.7500 % SAGB 7 3/4 02/28/23 #2023 2023	0	1'000	1'000	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZAG000096173	8.7500 % SAGB 8 3/4 02/28/48 #2048 2048 1'800		0	1'800	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZAG000106972	8.7500 % SAGB 8 3/4 01/31/44 #2044 2044	0	1'000	1'000	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZAG000106998	8.0000 % SAGB 8 01/31/30 #2030 2030	300	0	300	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZAG000107004	8.2500 % SAGB 8 1/4 03/31/32 #2032 2032 2'000		0	2'000	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZAG000107012	8.5000 % SAGB 8 1/2 01/31/37 #2037 2037 2'560		0	2'560	0	ZAR	0.00 %	0.00	0.00	
ZA								0.00	0.00	

Derivative Finanzinstrumente

-1'909.23 **0.00**

Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DKK/USD Verfall 02.12.2019	USD	80'984	DKK	550'000	0.00	0.00	
EUR/USD Verfall 02.12.2019	USD	1'287'064	EUR	1'170'000	0.00	0.00	
GBP/USD Verfall 02.12.2019	USD	154'524	GBP	120'000	0.00	0.00	
JPY/USD Verfall 02.12.2019	USD	594'298	JPY	65'000'000	0.00	0.00	
USD/NOK Verfall 02.12.2019	NOK	650'000	USD	70'845	0.00	0.00	
AUD/USD Verfall 02.12.2019	USD	122'056	AUD	180'000	0.00	0.00	
CAD/USD Verfall 02.12.2019	USD	112'904	CAD	150'000	0.00	0.00	
USD/CAD Verfall 04.12.2019	CAD	120'000	USD	90'203	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 30.12.2019	JPY	40'456'170	USD	370'000	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 30.12.2019	EUR	378'699	USD	420'000	0.00	0.00	
USD/GBP Verfall 03.01.2020	GBP	120'000	USD	157'144	0.00	0.00	
USD/DKK Verfall 05.05.2020	DKK	640'000	USD	93'981	0.00	0.00	
USD/GBP Verfall 05.05.2020	GBP	280'000	USD	353'210	0.00	0.00	
USD/AUD Verfall 05.05.2020	AUD	270'000	USD	176'784	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 08.05.2020	JPY	80'000'000	USD	748'202	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 11.05.2020	EUR	74'081	USD	80'000	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 11.05.2020	JPY	11'661'485	USD	110'000	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 27.05.2020	EUR	200'000	USD	217'832	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 27.05.2020	JPY	16'000'000	USD	148'887	0.00	0.00	
ILS/USD Verfall 03.06.2020	USD	28'541	ILS	100'000	0.00	0.00	
USD/SGD Verfall 03.06.2020	SGD	70'664	USD	50'000	0.00	0.00	
USD/AUD Verfall 03.06.2020	AUD	120'509	USD	80'000	0.00	0.00	
CAD/USD Verfall 04.06.2020	USD	96'377	CAD	130'000	0.00	0.00	
USD/CAD Verfall 29.06.2020	CAD	410'000	USD	300'314	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 07.07.2020	JPY	23'675'080	USD	220'000	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 07.07.2020	EUR	267'149	USD	300'000	0.00	0.00	
CAD/USD Verfall 15.07.2020	USD	125'433	CAD	170'000	0.00	0.00	
USD/CAD Verfall 21.08.2020	CAD	135'000	USD	102'580	0.00	0.00	
USD/DKK Verfall 02.09.2020	DKK	250'000	USD	39'966	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 02.09.2020	JPY	21'000'000	USD	199'439	0.00	0.00	
USD/AUD Verfall 02.09.2020	AUD	190'000	USD	139'615	0.00	0.00	
USD/PLN Verfall 02.09.2020	PLN	490'000	USD	132'833	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 02.09.2020	EUR	270'000	USD	321'281	0.00	0.00	
USD/CAD Verfall 02.09.2020	CAD	65'142	USD	50'000	0.00	0.00	
CAD/USD Verfall 02.10.2020	USD	82'344	CAD	110'000	0.00	0.00	

Devisentermingeschäfte

0.00 **0.00**

Class Hedge Devisentermingeschäfte

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DKK/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	78'945	DKK	555'000	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	327'629	AUD	525'800	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	339'084	CAD	471'300	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	6'705'267	EUR	6'309'100	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'150'380	GBP	931'800	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	4'071'340	JPY	453'975'200	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	153'639	MXN	3'164'800	0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
SEK/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	55'252	SEK	553'900	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	41'673	NOK	408'700	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	101'579	PLN	414'700	0.00	0.00	
ZAR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	97'984	ZAR	1'603'800	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	74'534	SGD	107'700	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	8'752'632	USD	9'062'900	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.04.2020	GBP	6'300	CHF	7'691	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	24'839	USD	26'000	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	8'567	AUD	13'800	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'953	CAD	2'800	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	40'504	EUR	38'200	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	6'837	GBP	5'600	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	33'590	JPY	3'774'300	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	59'276	USD	63'300	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	5'519	EUR	5'200	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.04.2020	GBP	3'100	CHF	3'773	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.04.2020	JPY	1'505'600	CHF	13'652	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	15'504	USD	16'700	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	6'348	EUR	6'000	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	3'917	JPY	437'800	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.04.2020	USD	12'200	CHF	11'436	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	6'656	EUR	6'300	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	2'152	GBP	1'800	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	4'040	JPY	447'700	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.04.2020	USD	14'400	CHF	13'721	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.04.2020	EUR	18'100	CHF	19'119	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	10'044	JPY	1'128'300	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'655	GBP	1'400	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	4'765	USD	5'000	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	2'607	AUD	4'500	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	2'636	CAD	3'900	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.04.2020	EUR	8'500	CHF	8'964	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.04.2020	JPY	275'700	CHF	2'471	0.00	0.00	
CHF/AUD Verfall 02.04.2020	AUD	11'200	CHF	6'445	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	3'595	EUR	3'400	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	4'705	JPY	524'300	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	4'137	USD	4'300	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	2'207	CAD	3'300	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	2'489	AUD	4'400	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	5'268	EUR	5'000	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.04.2020	GBP	5'500	CHF	6'294	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.04.2020	JPY	1'259'900	CHF	11'308	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	6'220	USD	6'400	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.04.2020	EUR	1'400	CHF	1'476	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.04.2020	USD	9'400	CHF	9'248	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'206	MXN	29'600	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'491	GBP	1'300	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	2'822	JPY	315'400	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	14'684	USD	14'900	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'991	CAD	2'900	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.04.2020	EUR	7'500	CHF	7'908	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	4'978	GBP	4'300	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.04.2020	JPY	1'281'400	CHF	11'360	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'843	AUD	3'200	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'268	EUR	1'200	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	12'266	JPY	1'389'900	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.04.2020	USD	20'200	CHF	19'841	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	9'407	EUR	8'900	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	1'535	GBP	1'300	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.04.2020	JPY	1'913'800	CHF	16'918	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	5'161	USD	5'400	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.04.2020	GBP	7'900	CHF	9'413	0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
USD/CHF Verfall 02.04.2020	CHF	6'238	USD	6'500	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	9'209'925	USD	9'536'700	0.00	0.00	
ZAR/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	77'126	ZAR	1'433'700	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	100'642	PLN	433'000	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	1'158'536	GBP	966'800	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	55'886	SEK	573'100	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	6'656'420	EUR	6'272'600	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	130'609	MXN	3'188'700	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	79'715	DKK	561'000	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	39'872	NOK	433'600	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	338'390	CAD	498'600	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	323'769	AUD	547'700	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	77'415	SGD	114'100	0.00	0.00	
ZAR/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	3'315	ZAR	62'300	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 05.05.2020	USD	44'500	CHF	42'919	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 05.05.2020	GBP	16'400	CHF	19'618	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 05.05.2020	EUR	65'000	CHF	68'685	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 05.05.2020	EUR	4'400	CHF	4'644	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	10'741	USD	11'000	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	2'589	AUD	4'200	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	2'627	CAD	3'800	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	71'328	EUR	67'700	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	8'830	GBP	7'300	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	77'956	USD	81'200	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 05.05.2020	CHF	6'105	EUR	5'800	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 05.05.2020	USD	9'300	CHF	8'975	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 07.05.2020	CHF	4'058'055	JPY	452'869'000	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 07.05.2020	JPY	2'275'700	CHF	20'441	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 07.05.2020	JPY	323'000	CHF	2'910	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 07.05.2020	CHF	42'656	JPY	4'761'700	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 07.05.2020	CHF	6'106	JPY	679'600	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	79'527	SGD	116'100	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	1'240'277	GBP	1'019'600	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	349'467	CAD	503'300	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	369'096	AUD	584'600	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	92'664	DKK	654'200	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	7'112'821	EUR	6'730'400	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	131'695	MXN	3'268'900	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	101'714	PLN	436'900	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	4'208'425	JPY	466'511'700	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	56'028	SEK	567'300	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	40'974	NOK	434'200	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	8'483'320	USD	8'796'000	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	78'772	ILS	283'400	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	64'705	USD	66'700	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	88'662	EUR	84'200	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	14'981	GBP	12'400	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	17'821	JPY	1'960'100	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	2'376	AUD	3'800	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	2'351	CAD	3'400	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	1'668	MXN	41'300	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	1'708	DKK	12'100	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 03.06.2020	EUR	2'200	CHF	2'316	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 03.06.2020	GBP	2'100	CHF	2'530	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	7'863	JPY	855'600	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	2'951	AUD	4'700	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	69'630	EUR	66'200	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	14'276	CAD	20'700	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	9'844	GBP	8'300	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	34'453	JPY	3'803'700	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	78'863	USD	81'300	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 03.06.2020	EUR	11'600	CHF	12'187	0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % (7)	Kat.
CHF/GBP Verfall 03.06.2020	GBP	1'700	CHF	2'014	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	2'506	JPY	276'200	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	14'275	USD	14'700	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	17'359	EUR	16'400	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 03.06.2020	GBP	2'200	CHF	2'607	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 03.06.2020	CHF	13'308	JPY	1'471'400	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 03.06.2020	USD	24'500	CHF	23'819	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	57'125	SEK	560'400	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	1'214'500	GBP	1'023'200	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	362'474	CAD	521'900	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	93'942	DKK	655'400	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	7'319'848	EUR	6'851'000	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	4'188'184	JPY	469'823'400	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	8'381'201	USD	8'730'600	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	145'618	MXN	3'372'600	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	106'463	PLN	444'200	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	386'098	AUD	606'000	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	43'274	NOK	438'100	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	86'925	SGD	128'000	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	73'830	ILS	269'400	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	2'010	MXN	45'500	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	68'908	USD	71'800	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	12'053	GBP	10'000	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	10'377	JPY	1'173'500	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	3'572	AUD	5'400	0.00	0.00	
CHF/CAD Verfall 02.07.2020	CAD	13'700	CHF	9'751	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	30'822	EUR	28'700	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.07.2020	EUR	2'100	CHF	2'280	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.07.2020	JPY	142'700	CHF	1'253	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	5'546	USD	5'800	0.00	0.00	
CHF/AUD Verfall 02.07.2020	AUD	1'800	CHF	1'202	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	4'320	EUR	4'000	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.07.2020	GBP	3'100	CHF	3'761	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	3'850	JPY	437'500	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	1'242	USD	1'300	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	2'315	AUD	3'500	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	55'377	EUR	51'400	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	18'946	GBP	15'700	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	24'285	JPY	2'757'200	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	48'462	USD	51'100	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.07.2020	GBP	2'800	CHF	3'376	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.07.2020	EUR	4'700	CHF	5'045	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	3'537	JPY	401'300	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	11'338	USD	12'000	0.00	0.00	
CHF/AUD Verfall 02.07.2020	AUD	1'800	CHF	1'166	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.07.2020	EUR	2'000	CHF	2'138	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.07.2020	JPY	133'100	CHF	1'172	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	2'816	USD	3'000	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	3'144	JPY	355'000	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	5'450	EUR	5'100	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.07.2020	USD	9'900	CHF	9'414	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	4'751	AUD	7'300	0.00	0.00	
CHF/SEK Verfall 02.07.2020	SEK	52'000	CHF	5'280	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	2'766	EUR	2'600	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.07.2020	JPY	436'500	CHF	3'865	0.00	0.00	
CHF/SGD Verfall 02.07.2020	SGD	11'900	CHF	8'115	0.00	0.00	
CHF/MXN Verfall 02.07.2020	MXN	42'800	CHF	1'778	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	6'654	PLN	27'900	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	15'938	USD	16'800	0.00	0.00	
CHF/DKK Verfall 02.07.2020	DKK	60'800	CHF	8'679	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.07.2020	CHF	6'740	CAD	9'700	0.00	0.00	
CHF/NOK Verfall 02.07.2020	NOK	40'700	CHF	3'979	0.00	0.00	
CHF/ILS Verfall 02.07.2020	ILS	25'000	CHF	6'901	0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
GBP/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	1'210'599	GBP	1'034'700	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	349'653	CAD	503'000	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	79'462	SGD	117'100	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	8'539'391	USD	9'021'500	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	86'865	DKK	608'600	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	7'567'081	EUR	7'112'700	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	414'548	AUD	636'000	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	4'083'770	JPY	465'189'700	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	53'025	SEK	521'700	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	141'111	MXN	3'460'400	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	39'567	NOK	403'200	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	114'439	PLN	478'200	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	68'589	ILS	250'600	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	16'760	USD	17'700	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	7'252	JPY	822'300	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 04.08.2020	GBP	2'800	CHF	3'287	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	17'415	EUR	16'400	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	8'819	JPY	1'004'100	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	2'457	USD	2'600	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	2'017	EUR	1'900	0.00	0.00	
CHF/CAD Verfall 04.08.2020	CAD	1'900	CHF	1'320	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 04.08.2020	GBP	5'100	CHF	6'018	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	3'459	SEK	33'600	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	5'084	SGD	7'500	0.00	0.00	
CHF/MXN Verfall 04.08.2020	MXN	103'000	CHF	4'308	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	7'347	PLN	30'800	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	5'632	DKK	39'200	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 04.08.2020	EUR	9'300	CHF	9'951	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	4'408	ILS	16'100	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 04.08.2020	JPY	2'539'700	CHF	22'279	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	2'600	NOK	25'900	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	6'291	GBP	5'300	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	13'150	AUD	20'000	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	4'789	CAD	6'900	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 04.08.2020	USD	21'400	CHF	20'132	0.00	0.00	
CHF/PLN Verfall 04.08.2020	PLN	67'900	CHF	16'342	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	1'673	CAD	2'400	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	14'620	USD	15'500	0.00	0.00	
CHF/AUD Verfall 04.08.2020	AUD	14'900	CHF	9'872	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	5'834	GBP	4'900	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	1'918	JPY	217'800	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	1'812	CAD	2'600	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	2'112	AUD	3'200	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	1'392	MXN	33'000	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 04.08.2020	GBP	5'300	CHF	6'300	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 04.08.2020	EUR	10'600	CHF	11'405	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 04.08.2020	GBP	1'500	CHF	1'781	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 04.08.2020	JPY	690'800	CHF	6'036	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 04.08.2020	CHF	22'377	USD	24'400	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	1'250'755	GBP	1'048'300	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	72'446	ILS	271'100	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	4'067'715	JPY	473'058'300	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	7'829'537	EUR	7'280'500	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	437'338	AUD	670'900	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	353'795	CAD	521'400	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	8'411'473	USD	9'254'900	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	85'102	SGD	128'400	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	58'795	SEK	565'500	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	95'795	DKK	663'500	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	43'915	NOK	438'600	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	109'327	PLN	448'800	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	142'162	MXN	3'484'700	0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % (7)	Kat.
JPY/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	37'940	JPY	4'371'700	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.09.2020	EUR	21'500	CHF	23'249	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	8'563	USD	9'300	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.09.2020	GBP	1'300	CHF	1'555	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	10'758	EUR	10'000	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.09.2020	JPY	600'000	CHF	5'186	0.00	0.00	
CHF/SGD Verfall 02.09.2020	SGD	2'700	CHF	1'799	0.00	0.00	
CHF/ILS Verfall 02.09.2020	ILS	5'700	CHF	1'525	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.09.2020	JPY	998'600	CHF	8'601	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	8'121	EUR	7'500	0.00	0.00	
CHF/PLN Verfall 02.09.2020	PLN	9'400	CHF	2'309	0.00	0.00	
CHF/MXN Verfall 02.09.2020	MXN	73'300	CHF	3'022	0.00	0.00	
CHF/SEK Verfall 02.09.2020	SEK	11'900	CHF	1'250	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	13'554	GBP	11'300	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	4'411	AUD	6'700	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	6'359	CAD	9'200	0.00	0.00	
CHF/DKK Verfall 02.09.2020	DKK	13'900	CHF	2'022	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.09.2020	USD	7'600	CHF	6'915	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.09.2020	JPY	201'800	CHF	1'727	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.09.2020	EUR	3'100	CHF	3'328	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	7'357	USD	8'100	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	4'087	JPY	476'100	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	16'207	AUD	24'400	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	17'153	PLN	70'000	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.09.2020	USD	54'500	CHF	49'276	0.00	0.00	
CHF/CAD Verfall 02.09.2020	CAD	2'900	CHF	2'001	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 02.09.2020	CHF	4'870	DKK	33'700	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	138'348	MXN	3'378'800	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	365'939	CAD	530'000	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	124'440	PLN	507'400	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	463'936	AUD	697'200	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	97'595	DKK	674'900	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	57'058	SEK	546'900	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	8'147'494	USD	9'055'900	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	4'023'549	JPY	474'050'300	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	81'390	SGD	123'000	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	1'239'653	GBP	1'028'800	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	43'871	NOK	423'100	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	7'798'310	EUR	7'242'600	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	1'736	EUR	1'600	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	1'940	AUD	2'900	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	24'022	USD	26'500	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	4'023	GBP	3'300	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	1'459	CAD	2'100	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	41'912	JPY	4'898'900	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.10.2020	JPY	988'200	CHF	8'474	0.00	0.00	
CHF/GBP Verfall 02.10.2020	GBP	2'000	CHF	2'421	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	14'284	USD	15'700	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.10.2020	JPY	266'300	CHF	2'292	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.10.2020	EUR	4'000	CHF	4'319	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	9'329	USD	10'200	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	4'295	EUR	4'000	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.10.2020	JPY	138'000	CHF	1'195	0.00	0.00	
CHF/USD Verfall 02.10.2020	USD	1'400	CHF	1'271	0.00	0.00	
CHF/JPY Verfall 02.10.2020	JPY	295'300	CHF	2'586	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	10'386	USD	11'300	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 02.10.2020	EUR	4'500	CHF	4'843	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 02.10.2020	CHF	3'709	USD	4'000	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 05.10.2020	CHF	70'606	ILS	263'000	0.00	0.00	
MXN/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	139'441	MXN	3'366'100	20.65	0.00	b)
GBP/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	1'239'653	GBP	1'044'600	-209.17	0.00	b)
SGD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	85'052	SGD	126'500	-21.95	0.00	b)
EUR/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	7'764'170	EUR	7'207'800	-217.20	0.00	b)

Class Hedge Devisentermingeschäfte	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ILS/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	69'731	ILS	259'700	23.06	0.00	b)
PLN/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	119'708	PLN	504'200	-1.32	0.00	b)
CAD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	351'558	CAD	511'500	12.17	0.00	b)
DKK/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	97'685	DKK	675'200	-17.17	0.00	b)
NOK/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	41'340	NOK	421'400	-4.29	0.00	b)
SEK/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	55'859	SEK	544'500	-2.00	0.00	b)
USD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	8'400'971	USD	9'152'800	-1'596.34	0.00	b)
AUD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	492'694	AUD	748'900	-115.63	0.00	b)
JPY/CHF Verfall 04.11.2020	CHF	4'008'104	JPY	460'601'000	219.96	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen					-1'909.23	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	932'952.14	0.54
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	169'335'519.29	98.87
Derivative Finanzinstrumente	-1'909.23	0.00
Sonstige Vermögenswerte	1'000'512.03	0.58
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	171'267'074.23	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-7'209.91	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	171'259'864.32	

Bewertungskategorien

	Kurswert USD	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	169'335'519.29	98.87
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'909.23	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

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Umrechnungskurse

AUD	1 = USD	0.71675000
CAD	1 = USD	0.74864308
DKK	1 = USD	0.15753613
EUR	1 = USD	1.17264913
GBP	1 = USD	1.29280000
ILS	1 = USD	0.29237201
JPY	1 = USD	0.00947598
MXN	1 = USD	0.04529857
MYR	1 = USD	0.24064493
NOK	1 = USD	0.10687643
PLN	1 = USD	0.25864187
SEK	1 = USD	0.11173184
SGD	1 = USD	0.73254707

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	24'888'125.83	14.53
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	15'750'757.23	9.20

* 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.

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Ausgabespesen in % des Nettoinventar- wertes	Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Rücknahme- spesen in % des Nettoinventar- wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.10.2019 – 30.09.2020	0.00 - 0.12	0.00	0.083	0.00 - 0.25	0.00	0.091

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. 4 geregelt. 26)

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten: 0.00

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten: 0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements: Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission 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:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II)

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF
DA USD	01.10.2019 – 30.09.2020	0.18 %	0.13 %	0.05 %
FA USD	01.10.2019 – 30.09.2020	0.20 %	0.10 %	0.10 %
GT USD	01.10.2019 – 30.09.2020	0.14 %	0.09 %	0.05 %
NT USD	01.10.2019 – 30.09.2020	0.00 %	0.00 %	0.00 %
NTH CHF	02.03.2020 – 30.09.2020	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Gemäss Richtlinie für Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebühren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): 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.

Benchmark

FTSE non-CHF World Government Bond Index

TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der SFAMA - Swiss Funds & Asset Management Association (Stand: 20. April 2015) herausgegeben wurden, ermittelt.

Ausschüttung des Nettoertrags 2019 / 2020

Ex Datum: 12.01.2021

Zahlbar: 15.01.2021

			Ausschüttung des Ertrags an Anteilscheininhaber mit Domizil			
			in der Schweiz			im Ausland
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungssteuer	Netto je Anteil	Netto je Anteil
DA USD	Ja	USD	1.60	0.56	1.04	1.56
FA USD	Ja	USD	1.40	0.49	0.91	1.40

Thesaurierung des Nettoertrags 2019 / 2020

Ex Datum: 12.01.2021

Zahlbar: 15.01.2021

			Thesaurierung des Ertrags an Anteilscheininhaber mit Domizil				
			in der Schweiz			im Ausland	
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungssteuer	Netto je Anteil	Netto Thesaurierung je Anteil	Barauszahlung je Anteil
GT USD	Ja	USD	1.884	0.659	1.225	1.225	0.659
NT USD	Ja	USD	1.969	0.689	1.280	1.280	0.689
NTH CHF	Ja	USD	2.018	0.706	1.312	1.312	0.706

Erklärung der Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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 / Sacheilagen
- 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
- 21) Änderung von SSP auf Spread per 27.06.2018
- 26) Die Umstellung auf «Crossing Rate adjusted Spreads» (CRAS) bei den Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen erfolgte am 10.02.2020

Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens 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 Konstanthaltung 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 aktuellen 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 ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit der Währung des Anlagefonds, oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens (Fondsvermögen 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 Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen 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 Nettovermögen, getätigt wurden.

Pflichtpublikationen

Mitteilung an die Anleger

Des

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II)

vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

(nachfolgend der "Anlagefonds")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Anlagefonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Die geplanten Änderungen des Fondsvertrags haben insbesondere eine Erweiterung der Bestimmungen betreffend die Nebenkostenbelastung im Hinblick auf ausserordentliche Situationen zum Gegenstand (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 der vorliegenden Mitteilung).

Des Weiteren wird die Bestimmung betreffend die Ausgabe- oder Rücknahmekommissionen der verbundenen Zielfonds mit einem Vorbehalt ergänzt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Abschliessend wird im Fondsvertrag betreffend thesaurierenden Anteilsklassen eine Ergänzung vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung). Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

1. Erweiterung Bestimmungen der Nebenkostenbelastung

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen erhebt die Fondsleitung zugunsten des Fondsvermögens die Nebenkosten (namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben), die dem Anlagefonds im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen (Ausgabe- und Rücknahmespesen) (vgl. § 17 Ziff. 2). Die Ausgabe- und Rücknahmespesen betragen jeweils höchstens 2% des Nettoinventarwerts (vgl. § 18 Ziff. 3).

Neu kann der Höchstsatz der Ausgabe- und Rücknahmespesen vorübergehend überschritten werden. Daher wird § 18 Ziff. 3 des Fondsvertrags wie folgt ergänzt:

"In ausserordentlichen Situationen kann der Höchstsatz der Ausgabe- und Rücknahmespesen vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der FINMA mitgeteilt."

2. Ergänzung um Vorbehalt betreffend Kommissionshöchstgrenze bei verbundenen Zielfonds

Im Zusammenhang mit Investitionen in verbundenen Zielfonds kommt eine reduzierte pauschale Verwaltungskommission mit einer Höchstgrenze von 0.25% zur Anwendung. Darüberhinausgehende Ausgabe- oder Rücknahmekommissionen dürfen dem Fondsvermögen nicht belastet werden.

Neu wird diese Bestimmung durch den Vorbehalt ergänzt, dass Ausgabe- und Rücknahmekommissionen, welche über die definierte Höchstgrenze hinausgehen, nur dann belastet werden können, wenn sie zu Gunsten des Fondsvermögens des Zielfonds erhoben werden (vgl. § 19 Ziff. 3 des geänderten Fondsvertrags).

3. Zwischenthesaurierungen

Bei thesaurierenden Anteilsklassen sollen neu auch Zwischenthesaurierungen möglich sein. Entsprechend wird § 22 Ziff. 2 des Fondsvertrags ergänzt um den Hinweis, dass die Fondsleitung bei thesaurierenden Anteilsklassen zusätzlich Zwischenthesaurierungen aus den Erträgen vornehmen kann.

Jahresbericht per 30.09.2020
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II)
Valorenummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorenummer Klasse NTH CHF: 52 089 276
Valorenummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorenummer Klasse PV: 14 054 916
Valorenummer Klasse GT USD: 19 231 024
Valorenummer Klasse NT USD: 14 054 915 Rechnungswährung: USD

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf keine in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags des Anlagefonds in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag und der Jahres- und Halbjahresbericht des Anlagefonds, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 7. September 2020

Die Fondsleitung:
Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:
Zürcher Kantonalbank
Zürich

Bericht der Prüfungsgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfungsgesellschaft haben wir die beiliegende Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II), bestehend aus der Vermögensrechnung und der Erfolgsrechnung, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b - h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) für das am 30. September 2020 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Prospekt mit integriertem Fondsvertrag verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems, mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnung, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern ist. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfungsgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnung abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnung frei von wesentlichen falschen Angaben ist.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in der Jahresrechnung enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in der Jahresrechnung als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnung von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnung. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entspricht die Jahresrechnung für das am 30. September abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Prospekt mit integriertem Fondsvertrag.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhängigkeit gemäss Revisionsaufsichtsgesetz erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 29. Januar 2021