

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

Halbjahresbericht per 31.03.2024

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
DA USD	11498197	USD
FA USD	11498196	USD
GT USD	19231024	USD
NT USD	14054915	USD
NTH1 CHF	52089276	CHF

Rechnungswährung: USD

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	36
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	36
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	37
7	Pauschale Verwaltungskommission	37
8	Benchmark	37
9	TER	37
10	Fussnoten	38
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	39

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer
Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services
Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidiert USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		295'437'457.03	252'294'531.63	221'849'609.05	238'263'696.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		-82'955.480	-	-	-
Klasse DA USD USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'176'595.35	23'507'203.96	19'652'885.58	24'621'243.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		350'520.826	352'144.091	292'006.757	279'949.563
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		68.9733	66.7545	67.3028	87.9489
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		62.1243	61.0670	66.2428	82.0431
Ausschüttung je Anteil		-	1.35	1.25	1.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse FA USD USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'003'521.00	582'050.26	200'977.66	289'399.29
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'547.858	8'718.358	2'990.000	3'287.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		68.9807	66.7615	67.2166	88.0436
Ausschüttung je Anteil		-	1.35	1.15	1.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.19 %
Klasse GT USD USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		26'930'369.29	24'941'568.84	21'226'238.64	24'807'293.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		316'185.251	306'470.251	261'812.251	236'668.636
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.1728	81.3833	81.0743	104.8187
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		76.7151	74.4495	79.7974	97.7801
Thesaurierung je Anteil		-	1.63	1.45	1.76
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT USD USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		82'198'429.36	81'608'919.94	85'803'555.54	136'166'152.20
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		991'672.620	1'030'628.695	1'088'673.520	1'337'494.253
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.8887	79.1836	78.8148	101.8069
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		74.6578	72.4372	77.5734	94.9706
Thesaurierung je Anteil		-	1.70	1.54	1.86
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		161'128'542.03	121'654'788.63	94'965'951.63	52'379'607.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'789'808.402	1'406'068.638	1'127'026.911	502'664.485
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.0860	79.1496	82.9352	97.2066
Thesaurierung je Anteil (in USD)		-	1.85	1.61	1.92
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DA USD	5.35 %	4.96 %	-18.31 %	-7.10 %
Klasse FA USD	5.35 %	4.97 %	-18.31 %	-7.10 %
Klasse GT USD	5.36 %	5.02 %	-18.28 %	-7.06 %
Klasse NT USD	5.44 %	5.16 %	-18.17 %	-6.93 %
Klasse NTH1 CHF	3.16 %	1.76 %	-15.16 %	-3.36 %
Benchmark Hedge	-1.60 %	1.89 %	-15.21 %	-
Benchmark	5.48 %	5.19 %	-18.26 %	-6.97 %
Tracking Error 33)	-	0.08 %	0.08 %	1.30 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DA USD	-0.13 %
Klasse FA USD	-0.13 %
Klasse GT USD	-0.12 %
Klasse NT USD	-0.04 %
Klasse NTH1 CHF	4.76 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.03.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	5'536'459.79	924'979.87
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	265'556'892.05	234'146'395.75
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	22'948'091.73	15'455'531.96
Sonstige Vermögenswerte	2'189'922.92	1'776'769.73
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	296'231'366.49	252'303'677.31
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-787'434.79	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-6'474.67	-9'145.68
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	295'437'457.03	252'294'531.63

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse DA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		352'144.091	292'006.757
Ausgegebene Anteile		15'207.137	90'807.977
Zurückgenommene Anteile		-16'830.402	-30'670.643
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		350'520.826	352'144.091
Klasse FA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'718.358	2'990.000
Ausgegebene Anteile		6'510.500	5'743.358
Zurückgenommene Anteile		-681.000	-15.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		14'547.858	8'718.358
Klasse GT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		306'470.251	261'812.251
Ausgegebene Anteile		21'990.000	44'658.000
Zurückgenommene Anteile		-12'275.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		316'185.251	306'470.251
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'030'628.695	1'088'673.520
Ausgegebene Anteile		37'972.925	86'547.101
Zurückgenommene Anteile		-76'929.000	-144'591.926
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		991'672.620	1'030'628.695
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'406'068.638	1'127'026.911
Ausgegebene Anteile		387'259.764	640'456.932
Zurückgenommene Anteile		-3'520.000	-361'415.205
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'789'808.402	1'406'068.638

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		252'294'531.63	221'849'609.05
Ausbezahlte Ausschüttung		-499'340.60	-443'450.08
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'831'886.54	-1'318'980.00
Saldo aus dem Anteilverkehr		32'237'570.58	30'686'126.40
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		13'236'581.96	1'521'226.26
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		295'437'457.03	252'294'531.63

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		13'861.03	23'126.74
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-12.88	-932.00
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'043'062.19	4'827'140.10
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		0.00	353'735.32
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		213'306.36	929'919.49
Total Ertrag		3'270'216.70	6'132'989.65
Aufwand			
Passivzinsen		2'514.25	-2'839.09
Reglementarische Vergütungen		-40'281.16	-76'380.81
Sonstige Aufwendungen		22.96	-116.22
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-46'214.82	-700'913.16
Total Aufwand		-83'958.77	-780'249.28
Nettoertrag / Verlust		3'186'257.93	5'352'740.37
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'661'633.38	-8'790'030.63
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		50'144.82	94'480.93
Realisierter Erfolg		-425'230.63	-3'342'809.33
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		13'661'812.59	4'864'035.59
Gesamterfolg		13'236'581.96	1'521'226.26

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.	
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							265'556'892.05	89.65		
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							265'556'892.05	89.65		
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	130	0	0	130 EUR	110.68%	155'395.44	0.05	a)	
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	180	0	0	180 EUR	112.82%	219'325.00	0.07	a)	
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	100	50	0	150 EUR	103.52%	167'701.66	0.06	a)	
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	45	0	0	45 EUR	116.39%	56'565.29	0.02	a)	
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	100	0	0	100 EUR	101.74%	109'878.72	0.04	a)	
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	95	0	0	95 EUR	96.29%	98'793.11	0.03	a)	
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00		
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	170	0	30	140 EUR	97.04%	146'723.83	0.05	a)	
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	150	0	0	150 EUR	94.89%	153'725.98	0.05	a)	
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	110	0	0	110 EUR	74.91%	88'996.25	0.03	a)	
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	55	0	0	55 EUR	61.07%	36'275.42	0.01	a)	
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	178	0	20	158 EUR	93.37%	159'325.87	0.05	a)	
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	67	0	0	67 EUR	77.62%	56'165.58	0.02	a)	
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	110	0	0	110 EUR	92.93%	110'400.35	0.04	a)	
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	130	0	0	130 EUR	90.15%	126'570.04	0.04	a)	
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	168	0	0	168 EUR	85.62%	155'348.24	0.05	a)	
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	100	0	0	100 EUR	59.00%	63'719.72	0.02	a)	
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	42	0	0	42 EUR	47.39%	21'496.01	0.01	a)	
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	40	0	0	40 EUR	61.35%	26'503.08	0.01	a)	
AT0000A2NWX3	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	190	0	0	190 EUR	83.18%	170'684.61	0.06	a)	
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	35	0	0	35 EUR	46.03%	17'399.26	0.01	a)	
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	100	0	0	100 EUR	96.55%	104'273.54	0.04	a)	
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	100	0	0	100 EUR	72.16%	77'932.46	0.03	a)	
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	95	100	0	195 EUR	88.62%	186'639.22	0.06	a)	
AT0000A2W5C8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	100	50	0	150 EUR	86.99%	140'923.18	0.05	a)	
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	40	25	0	65 EUR	79.17%	55'577.10	0.02	a)	
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	50	0	0	50 EUR	98.01%	52'925.17	0.02	a)	
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	108	75	0	183 EUR	100.77%	199'160.95	0.07	a)	
AT0000A33SH3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	45	0	0	45 EUR	101.01%	49'090.64	0.02	a)	
AT0000A33SK7	3.1500 % RAGB 3.15 10/20/53	0	50	0	50 EUR	101.42%	54'766.56	0.02	a)	
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	0	50	0	50 EUR	104.41%	56'379.53	0.02	a)	
AT							3'118'661.81	1.05		
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	200	100	0	300 AUD	93.25%	182'506.94	0.06	a)	
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	175	0	0	175 AUD	81.61%	93'173.00	0.03	a)	
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	283	0	0	283 AUD	85.35%	157'577.33	0.05	a)	
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	290	25	0	315 AUD	81.61%	167'711.39	0.06	a)	
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	105	0	105	0 AUD	0.00%	0.00	0.00		
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	261	0	0	261 AUD	83.58%	142'308.50	0.05	a)	
AU0000095457	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/25 161	245	0	0	245 AUD	94.48%	151'014.94	0.05	a)	
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	222	0	0	222 AUD	58.62%	84'899.54	0.03	a)	
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	385	0	0	385 AUD	81.17%	203'880.45	0.07	a)	
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	315	0	0	315 AUD	92.68%	190'469.13	0.06	a)	
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	310	0	0	310 AUD	84.10%	170'083.16	0.06	a)	
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	250	0	0	250 AUD	92.23%	150'423.87	0.05	a)	
AU0000249302	3.7500 % ACGB 3 3/4 05/21/34 167	150	75	0	225 AUD	98.05%	143'920.26	0.05	a)	
AU0000274706	3.5000 % ACGB 3 1/2 12/21/34 168	175	0	0	175 AUD	95.60%	109'141.95	0.04	a)	
AU0000300535	4.7500 % ACGB 4 3/4 06/21/54 169	0	90	0	90 AUD	106.54%	62'558.38	0.02	a)	
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	250	0	0	250 AUD	104.10%	169'778.95	0.06	a)	
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	213	0	0	213 AUD	101.12%	140'517.57	0.05	a)	
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	113	100	0	213 AUD	88.54%	123'029.30	0.04	a)	
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	100	0	0	100 AUD	89.40%	58'325.21	0.02	a)	
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	220	0	0	220 AUD	97.10%	139'371.43	0.05	a)	
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	164	0	0	164 AUD	94.81%	101'435.28	0.03	a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	169	0	0	169 AUD	80.28%	88'517.61	0.03	a)
AU000XCLWAU3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	135	50	0	185 AUD	96.28%	116'209.01	0.04	a)
AU000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	170	0	0	170 AUD	95.23%	105'615.47	0.04	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	240	0	0	240 AUD	103.27%	161'702.30	0.05	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	245	0	0	245 AUD	98.12%	156'837.84	0.05	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	232	0	80	152 AUD	99.27%	98'444.86	0.03	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	170	0	0	170 AUD	96.44%	106'954.13	0.04	a)
AU							3'576'407.80	1.21	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	240	50	30	260 EUR	110.68%	310'774.03	0.10	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	303	0	0	303 EUR	119.54%	391'184.25	0.13	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	200	25	20	205 EUR	114.10%	252'616.29	0.09	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	90	50	0	140 EUR	103.02%	155'765.55	0.05	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	100	0	0	100 EUR	109.02%	117'741.08	0.04	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	100	0	0	100 EUR	107.58%	116'185.89	0.04	a)
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	100	0	0	100 EUR	101.38%	109'489.92	0.04	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	245	0	0	245 EUR	97.07%	256'846.09	0.09	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	180	25	0	205 EUR	89.07%	197'200.11	0.07	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	110	0	0	110 EUR	86.53%	102'797.19	0.03	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	200	0	20	180 EUR	96.07%	186'759.26	0.06	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	125	0	0	125 EUR	73.17%	98'779.07	0.03	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	110	0	0	110 EUR	76.26%	90'596.48	0.03	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	200	0	20	180 EUR	94.20%	183'123.99	0.06	a)
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	69	0	0	69 EUR	78.71%	58'654.43	0.02	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	40	0	0	40 EUR	83.04%	35'873.12	0.01	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	180	50	0	230 EUR	92.83%	230'598.64	0.08	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	115	0	0	115 EUR	88.18%	109'519.08	0.04	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	200	0	0	200 EUR	91.75%	198'179.13	0.07	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	120	0	0	120 EUR	72.36%	93'771.67	0.03	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	150	0	0	150 EUR	85.58%	138'638.99	0.05	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	102	0	0	102 EUR	65.31%	71'945.18	0.02	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	150	0	30	120 EUR	91.07%	118'026.20	0.04	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	150	0	0	150 EUR	81.75%	132'434.42	0.04	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	70	0	0	70 EUR	42.81%	32'364.22	0.01	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	160	50	0	210 EUR	82.53%	187'177.22	0.06	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	120	0	0	120 EUR	64.73%	83'889.71	0.03	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	58	0	0	58 EUR	95.88%	60'058.97	0.02	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	110	85	0	195 EUR	101.61%	213'989.72	0.07	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	70	60	0	130 EUR	99.13%	139'177.91	0.05	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	40	0	0	40 EUR	103.05%	44'517.40	0.02	a)
BE							4'518'675.21	1.53	
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	70	0	0	70 CAD	87.57%	45'298.65	0.02	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	120	0	0	120 CAD	89.37%	79'252.76	0.03	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	0	0	100 CAD	97.51%	72'055.42	0.02	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	85	0	0	85 CAD	94.83%	59'566.89	0.02	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	100	0	0	100 CAD	92.18%	68'118.97	0.02	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	100	0	0	100 CAD	94.13%	69'556.25	0.02	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	402	25	0	427 CAD	75.32%	237'646.44	0.08	a)
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	88	0	0	88 CAD	94.50%	61'452.06	0.02	a)
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	346	0	0	346 CAD	87.94%	224'838.00	0.08	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	280	0	0	280 CAD	94.84%	196'230.70	0.07	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	335	0	0	335 CAD	82.66%	204'636.54	0.07	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	180	0	0	180 CAD	93.01%	123'718.16	0.04	a)
CA135087L930	1.0000 % CAN 1 09/01/26	180	0	0	180 CAD	93.33%	124'142.47	0.04	a)
CA135087M276	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/31	392	0	0	392 CAD	87.59%	253'733.28	0.09	a)
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	355	0	0	355 CAD	69.91%	183'406.39	0.06	a)
CA135087M847	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/27	175	0	0	175 CAD	93.05%	120'334.57	0.04	a)
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	370	0	0	370 CAD	86.80%	237'322.22	0.08	a)
CA135087N340	1.5000 % CAN 1 1/2 04/01/25	150	0	0	150 CAD	96.99%	107'505.63	0.04	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	290	0	0	290 CAD	89.57%	191'941.11	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	50	0	0	50 CAD	94.13%	34'780.05	0.01	a)
CA135087N837	2.7500 % CAN 2 3/4 09/01/27	210	0	0	210 CAD	97.06%	150'622.72	0.05	a)
CA135087P246	3.0000 % CAN 3 10/01/25	130	0	0	130 CAD	98.08%	94'218.66	0.03	a)
CA135087P329	2.5000 % CAN 2 1/2 12/01/32	80	150	0	230 CAD	92.76%	157'654.31	0.05	a)
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	180	0	180	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P576	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/28	160	0	0	160 CAD	99.61%	117'769.22	0.04	a)
CA135087P659	3.7500 % CAN 3 3/4 02/01/25	150	0	150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P816	3.0000 % CAN 3 04/01/26	150	0	0	150 CAD	97.75%	108'345.83	0.04	a)
CA135087P998	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/55	90	60	0	150 CAD	88.34%	97'922.04	0.03	a)
CA135087Q236	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/33	150	0	0	150 CAD	94.28%	104'507.30	0.04	a)
CA135087Q319	3.7500 % CAN 3 3/4 05/01/25	165	0	0	165 CAD	99.17%	120'911.81	0.04	a)
CA135087Q491	3.2500 % CAN 3 1/4 09/01/28	155	50	0	205 CAD	98.71%	149'534.49	0.05	a)
CA135087Q640	3.5000 % CAN 3 1/2 08/01/25	250	0	0	250 CAD	98.85%	182'610.38	0.06	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	50	240	0	290 CAD	98.20%	210'437.24	0.07	a)
CA135087Q806	4.5000 % CAN 4 1/2 11/01/25	0	220	0	220 CAD	100.28%	163'021.91	0.06	a)
CA135087Q988	4.0000 % CAN 4 03/01/29	0	215	0	215 CAD	102.08%	162'176.65	0.05	a)
CA135087R226	4.5000 % CAN 4 1/2 02/01/26	0	150	0	150 CAD	100.54%	111'443.93	0.04	a)
CA135087R481	3.0000 % CAN 3 06/01/34	0	150	0	150 CAD	96.03%	106'443.75	0.04	a)
CA135087R556	4.0000 % CAN 4 05/01/26	0	75	0	75 CAD	99.89%	55'359.50	0.02	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	90	0	0	90 CAD	110.37%	73'399.96	0.02	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	170	0	0	170 CAD	117.40%	147'487.01	0.05	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	50	0	0	50 CAD	115.95%	42'841.31	0.01	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	70	0	0	70 CAD	107.10%	55'401.00	0.02	a)
CA135087Z568	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	127	0	0	127 CAD	101.12%	94'895.49	0.03	a)
CA							5'202'541.07	1.76	
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	170	0	100	70 EUR	86.96%	65'744.49	0.02	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	47	100	0	147 EUR	95.64%	151'835.81	0.05	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	120	0	0	120 EUR	53.53%	69'370.69	0.02	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	95	0	0	95 EUR	85.09%	87'297.85	0.03	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	100	0	0	100 EUR	96.31%	104'015.42	0.04	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	45	40	0	85 EUR	86.68%	79'575.56	0.03	a)
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	363	0	0	363 EUR	100.46%	393'845.57	0.13	a)
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	300	100	400	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	354	0	0	354 EUR	97.22%	371'693.69	0.13	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	312	100	0	412 EUR	95.82%	426'336.55	0.14	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	351	0	0	351 EUR	94.00%	356'341.21	0.12	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	365	0	50	315 EUR	93.75%	318'949.71	0.11	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	350	0	0	350 EUR	93.80%	354'558.66	0.12	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	378	30	0	408 EUR	78.21%	344'631.84	0.12	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	300	0	0	300 EUR	93.16%	301'820.87	0.10	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	330	0	0	330 EUR	91.50%	326'115.26	0.11	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	317	0	0	317 EUR	90.74%	310'662.94	0.10	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	320	0	0	320 EUR	88.71%	306'590.78	0.10	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	451	0	0	451 EUR	53.34%	259'807.33	0.09	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	340	0	0	340 EUR	87.79%	322'363.46	0.11	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	365	0	0	365 EUR	86.92%	342'633.19	0.12	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	261	0	0	261 EUR	77.32%	217'937.38	0.07	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	235	0	0	235 EUR	91.71%	232'758.96	0.08	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	295	0	0	295 EUR	85.98%	273'918.33	0.09	a)
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	280	0	0	280 EUR	75.22%	227'467.30	0.08	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	290	0	0	290 EUR	90.03%	281'972.72	0.10	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	345	0	0	345 EUR	85.10%	317'070.03	0.11	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	265	50	0	315 EUR	50.96%	173'375.36	0.06	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	350	0	0	350 EUR	84.09%	317'847.46	0.11	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	180	100	0	280 EUR	82.96%	250'857.84	0.08	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	305	0	0	305 EUR	95.92%	315'962.38	0.11	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	220	85	0	305 EUR	86.56%	285'137.27	0.10	a)
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	205	100	0	305 EUR	99.01%	326'121.04	0.11	a)
DE0001104909	2.2000 % BKO 2.2 12/12/24	130	0	130	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	179	100	50	229 EUR	112.12%	277'293.96	0.09	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	181	0	0	181 EUR	111.22%	217'411.90	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	150	0	0	150 EUR	109.39%	177'209.40	0.06	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	150	0	0	150 EUR	120.93%	195'904.12	0.07	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	232	0	0	232 EUR	119.90%	300'420.12	0.10	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	265	0	0	265 EUR	121.98%	349'099.50	0.12	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	305	0	0	305 EUR	117.37%	386'618.37	0.13	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	210	0	0	210 EUR	122.59%	278'021.56	0.09	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	257	0	50	207 EUR	130.32%	291'337.64	0.10	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	193	0	0	193 EUR	111.21%	231'803.02	0.08	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	330	50	0	380 EUR	100.22%	411'280.55	0.14	a)
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	280	0	30	250 EUR	96.71%	261'110.45	0.09	a)
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	298	0	0	298 EUR	95.65%	307'841.82	0.10	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	320	0	0	320 EUR	94.64%	327'074.40	0.11	a)
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	270	0	0	270 EUR	93.70%	273'230.91	0.09	a)
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	264	0	100	164 EUR	92.77%	164'304.65	0.06	a)
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	307	80	0	387 EUR	96.24%	402'230.40	0.14	a)
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	228	0	228	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE000BU22015	2.8000 % BKO 2.8 06/12/25	225	0	50	175 EUR	99.49%	188'033.38	0.06	a)
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	80	110	0	190 EUR	100.01%	205'227.83	0.07	a)
DE000BU22031	3.1000 % BKO 3.1 12/12/25 2Y	0	100	0	100 EUR	100.21%	108'227.40	0.04	a)
DE000BU22049	2.5000 % BKO 2 1/2 03/19/26 2Y	0	100	0	100 EUR	99.34%	107'284.57	0.04	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	300	0	0	300 EUR	99.30%	321'727.34	0.11	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	100	250	0	350 EUR	100.19%	378'716.53	0.13	a)
DE000BU25026	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 189	0	100	0	100 EUR	98.97%	106'889.29	0.04	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	0	195	0	195 EUR	100.80%	212'275.44	0.07	a)
DE000BU2D004	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/54	0	80	0	80 EUR	100.99%	87'257.57	0.03	a)
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	411	0	0	411 EUR	100.35%	445'431.62	0.15	a)
DE000BU2Z015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	60	325	0	385 EUR	102.70%	427'041.35	0.14	a)
DE000BU2Z023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	0	100	0	100 EUR	99.17%	107'107.45	0.04	a)
DE000BU3Z005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	75	50	0	125 EUR	100.36%	135'486.75	0.05	a)
DE							16'197'516.24	5.47	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	1'230	0	0	1'230 DKK	125.73%	223'914.68	0.08	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	550	0	0	550 DKK	98.29%	78'273.37	0.03	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	650	0	0	650 DKK	93.60%	88'090.93	0.03	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	1'000	0	400	600 DKK	90.86%	78'933.47	0.03	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	700	0	0	700 DKK	55.43%	56'177.37	0.02	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	500	0	0	500 DKK	84.46%	61'147.47	0.02	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	650	0	650	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	500	0	0	500 DKK	99.01%	71'677.41	0.02	a)
DK							658'214.70	0.22	
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	430	0	0	430 EUR	114.34%	530'969.40	0.18	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	219	50	0	269 EUR	116.97%	339'813.94	0.11	a)
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	230	0	0	230 EUR	115.13%	285'971.73	0.10	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	230	100	65	265 EUR	101.78%	291'298.80	0.10	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	260	0	0	260 EUR	106.40%	298'758.65	0.10	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	250	50	0	300 EUR	120.17%	389'345.85	0.13	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	50	0	0	50 EUR	109.95%	59'372.74	0.02	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	175	0	0	175 EUR	122.36%	231'251.82	0.08	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	50	0	50	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	200	100	62	238 EUR	98.16%	252'299.07	0.09	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	257	50	0	307 EUR	94.79%	314'297.60	0.11	a)
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	300	0	0	300 EUR	98.54%	319'271.44	0.11	a)
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	230	0	0	230 EUR	97.89%	243'150.24	0.08	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	210	0	0	210 EUR	89.13%	202'139.15	0.07	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	178	0	0	178 EUR	92.72%	178'238.38	0.06	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	235	85	0	320 EUR	96.05%	331'940.43	0.11	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	315	0	0	315 EUR	96.02%	326'645.00	0.11	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	230	0	0	230 EUR	94.25%	234'103.55	0.08	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	170	50	0	220 EUR	109.20%	259'453.31	0.09	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	269	0	0	269 EUR	95.36%	277'041.56	0.09	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	256	100	0	356 EUR	94.61%	363'747.24	0.12	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	215	0	0	215 EUR	84.83%	196'965.11	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	280	0	0	280 EUR	94.37%	285'358.50	0.10	a)
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	272	0	0	272 EUR	93.68%	275'178.47	0.09	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	280	0	50	230 EUR	87.10%	216'355.45	0.07	a)
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	245	0	0	245 EUR	88.63%	234'521.89	0.08	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	275	0	0	275 EUR	87.06%	258'561.12	0.09	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	300	0	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	234	25	0	259 EUR	55.53%	155'322.24	0.05	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	263	0	0	263 EUR	93.56%	265'732.45	0.09	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	270	0	0	270 EUR	90.30%	263'316.56	0.09	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	215	0	0	215 EUR	71.06%	164'995.95	0.06	a)
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	208	0	0	208 EUR	94.65%	212'625.32	0.07	a)
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	244	50	0	294 EUR	82.32%	261'381.31	0.09	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	80	0	0	80 EUR	50.08%	43'264.61	0.01	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	284	0	0	284 EUR	89.88%	275'681.79	0.09	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	193	0	0	193 EUR	73.16%	152'487.78	0.05	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	250	0	0	250 EUR	83.64%	225'829.71	0.08	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	95	50	0	145 EUR	66.22%	103'703.20	0.04	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	270	0	0	270 EUR	92.21%	268'883.18	0.09	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	270	0	0	270 EUR	83.85%	244'496.78	0.08	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	274	0	50	224 EUR	96.24%	232'830.04	0.08	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	169	50	0	219 EUR	68.65%	162'358.44	0.05	a)
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	249	0	0	249 EUR	90.05%	242'166.77	0.08	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	251	0	0	251 EUR	96.51%	261'623.58	0.09	a)
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	120	0	0	120 EUR	97.69%	126'605.68	0.04	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	205	50	0	255 EUR	99.55%	274'151.23	0.09	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	250	50	0	300 EUR	100.68%	326'192.05	0.11	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	95	0	0	95 EUR	104.77%	107'494.57	0.04	a)
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	200	55	0	255 EUR	103.61%	285'332.42	0.10	a)
ES0000012M51	3.5000 % SPGB 3 1/2 05/31/29	0	150	0	150 EUR	103.17%	167'128.18	0.06	a)
ES0000012M77	2.5000 % SPGB 2 1/2 05/31/27	0	80	0	80 EUR	98.84%	85'400.84	0.03	a)
ES0000012M85	3.2500 % SPGB 3 1/4 04/30/34	0	220	0	220 EUR	100.81%	239'518.75	0.08	a)
ES0000012M93	4.0000 % SPGB 4 10/31/54	0	70	0	70 EUR	103.87%	78'526.89	0.03	a)
ES							12'423'100.76	4.19	
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	50	0	0	50 EUR	100.17%	54'093.72	0.02	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	90	0	0	90 EUR	95.02%	92'362.92	0.03	a)
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	140	0	0	140 EUR	87.81%	132'766.62	0.04	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	30	0	0	30 EUR	96.87%	31'386.07	0.01	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	100	0	0	100 EUR	95.20%	102'812.31	0.03	a)
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	55	0	0	55 EUR	73.96%	43'933.83	0.01	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	100	0	0	100 EUR	92.66%	100'068.04	0.03	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34	50	0	0	50 EUR	85.50%	46'170.34	0.02	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	80	0	0	80 EUR	90.92%	78'554.53	0.03	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29	84	0	0	84 EUR	89.25%	80'967.24	0.03	a)
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36	50	0	0	50 EUR	72.04%	38'899.27	0.01	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	20	0	0	20 EUR	64.88%	14'013.37	0.00	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	50	0	0	50 EUR	47.82%	25'819.99	0.01	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31	70	0	0	70 EUR	82.85%	62'635.84	0.02	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26	100	0	0	100 EUR	93.27%	100'732.24	0.03	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43	55	0	0	55 EUR	64.27%	38'173.24	0.01	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32	50	50	0	100 EUR	90.73%	97'983.65	0.03	a)
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38	50	0	0	50 EUR	97.45%	52'620.07	0.02	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33	60	0	0	60 EUR	101.71%	65'907.14	0.02	a)
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	0	50	0	50 EUR	100.95%	54'512.76	0.02	a)
FI							1'314'413.19	0.44	
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	387	0	0	387 EUR	122.45%	511'789.77	0.17	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	332	0	0	332 EUR	104.31%	374'012.29	0.13	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	400	250	100	550 EUR	113.18%	672'286.24	0.23	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	288	50	0	338 EUR	117.62%	429'358.16	0.14	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	195	60	0	255 EUR	113.84%	313'513.98	0.11	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	260	0	0	260 EUR	111.35%	312'669.42	0.11	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	387	60	0	447 EUR	118.47%	571'923.26	0.19	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	224	0	0	224 EUR	115.52%	279'464.75	0.09	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	477	0	0	477 EUR	101.19%	521'288.11	0.18	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	567	100	0	667 EUR	100.15%	721'437.37	0.24	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	310	50	0	360 EUR	101.03%	392'802.91	0.13	a)
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	649	150	75	724 EUR	99.28%	776'286.76	0.26	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	70	0	70	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	491	100	175	416 EUR	96.87%	435'215.62	0.15	a)
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	430	0	0	430 EUR	96.74%	449'258.58	0.15	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	665	0	0	665 EUR	92.61%	665'122.09	0.22	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	550	100	100	550 EUR	95.13%	565'069.71	0.19	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	190	0	0	190 EUR	68.26%	140'068.90	0.05	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	548	0	0	548 EUR	82.97%	491'047.49	0.17	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	476	75	70	481 EUR	93.62%	486'335.04	0.16	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	360	0	0	360 EUR	84.61%	328'962.23	0.11	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	450	0	0	450 EUR	94.87%	461'066.17	0.16	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	320	50	0	370 EUR	79.91%	319'318.96	0.11	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	712	50	50	712 EUR	92.62%	712'207.62	0.24	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	500	0	0	500 EUR	86.26%	465'801.95	0.16	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	640	0	0	640 EUR	91.86%	634'933.53	0.21	a)
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	390	0	0	390 EUR	69.97%	294'712.34	0.10	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	663	0	0	663 EUR	89.87%	643'502.32	0.22	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	540	0	540	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	500	0	0	500 EUR	86.42%	466'665.95	0.16	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	319	50	0	369 EUR	55.00%	219'185.04	0.07	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	492	0	0	492 EUR	94.63%	502'823.76	0.17	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	290	0	0	290 EUR	67.42%	211'158.51	0.07	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	617	0	0	617 EUR	84.11%	560'472.93	0.19	a)
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072	136	0	0	136 EUR	39.28%	57'694.21	0.02	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	230	0	0	230 EUR	60.87%	151'200.41	0.05	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	575	100	100	575 EUR	81.74%	507'603.17	0.17	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	474	0	0	474 EUR	92.42%	473'114.38	0.16	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	355	0	0	355 EUR	53.74%	206'038.25	0.07	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32	425	0	0	425 EUR	80.51%	369'539.27	0.12	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	400	250	650	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	150	100	0	250 EUR	79.56%	214'811.06	0.07	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	501	75	0	576 EUR	92.97%	578'345.23	0.20	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	560	0	0	560 EUR	94.41%	570'989.17	0.19	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	150	0	0	150 EUR	90.24%	146'188.16	0.05	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	185	50	0	235 EUR	94.66%	240'246.02	0.08	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	315	200	0	515 EUR	99.20%	551'747.97	0.19	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	285	90	0	375 EUR	101.86%	412'531.19	0.14	a)
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29	120	300	0	420 EUR	100.45%	455'639.20	0.15	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33	0	360	0	360 EUR	105.81%	411'387.47	0.14	a)
FR001400NBC6	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/27	0	90	0	90 EUR	99.28%	96'499.74	0.03	a)
FR001400NEF3	3.0000 % FRTR 3 06/25/49	0	75	0	75 EUR	96.59%	78'237.56	0.03	a)
FR							20'451'574.22	6.90	
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	145	0	0	145 GBP	109.32%	200'242.81	0.07	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	220	0	0	220 GBP	103.19%	286'780.49	0.10	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	230	0	230	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	185	0	0	185 GBP	102.12%	238'655.72	0.08	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	165	0	0	165 GBP	106.10%	221'150.86	0.07	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	205	0	0	205 GBP	97.48%	252'440.30	0.09	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	181	0	0	181 GBP	97.85%	223'732.31	0.08	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	150	0	0	150 GBP	101.15%	191'666.61	0.06	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	191	60	0	251 GBP	102.06%	323'607.51	0.11	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	210	0	0	210 GBP	105.83%	280'748.47	0.09	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	135	50	50	135 GBP	97.61%	166'462.87	0.06	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	137	60	0	197 GBP	100.16%	249'258.43	0.08	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	160	0	0	160 GBP	104.62%	211'457.94	0.07	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	120	0	0	120 GBP	93.67%	141'994.35	0.05	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	160	0	0	160 GBP	99.56%	201'230.67	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
GB00B6RNH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	155	0	0	155 GBP	89.63%	175'498.90	0.06	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	210	50	0	260 GBP	85.07%	279'408.16	0.09	a)
GB00BBJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	164	0	0	164 GBP	84.66%	175'392.66	0.06	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	210	0	0	210 GBP	54.89%	145'613.56	0.05	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	239	70	50	259 GBP	58.12%	190'158.03	0.06	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	180	0	0	180 GBP	91.79%	208'716.69	0.07	a)
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	155	0	0	155 GBP	47.82%	93'633.35	0.03	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	109	0	0	109 GBP	60.44%	83'222.40	0.03	a)
GB00BFX02L78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	180	0	0	180 GBP	91.09%	207'125.00	0.07	a)
GB00BJLROJ16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	140	0	0	140 GBP	54.11%	95'696.24	0.03	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	155	0	0	155 GBP	85.64%	167'686.33	0.06	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	272	0	0	272 GBP	62.72%	215'508.43	0.07	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	190	0	0	190 GBP	95.60%	229'456.73	0.08	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	200	0	0	200 GBP	80.56%	203'534.84	0.07	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	178	0	0	178 GBP	92.96%	209'028.46	0.07	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	360	0	0	360 GBP	100.04%	454'951.91	0.15	a)
GB00BLDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	135	0	0	135 GBP	38.07%	64'924.10	0.02	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	266	50	0	316 GBP	50.52%	201'669.27	0.07	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	154	200	354	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	327	0	0	327 GBP	85.48%	353'103.13	0.12	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	264	0	0	264 GBP	66.09%	220'408.83	0.07	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	230	75	0	305 GBP	76.60%	295'133.10	0.10	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	420	0	0	420 GBP	81.07%	430'129.05	0.15	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	165	0	0	165 GBP	52.78%	110'012.65	0.04	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	330	0	0	330 GBP	31.02%	129'313.85	0.04	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	247	0	60	187 GBP	41.71%	98'530.59	0.03	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	90	100	0	190 GBP	86.81%	208'359.19	0.07	a)
GB00BMF9LF76	4.0000 % UKT 4 10/22/63	0	90	0	90 GBP	93.39%	106'177.43	0.04	a)
GB00BMF9LG83	4.5000 % UKT 4 1/2 06/07/28	100	280	0	380 GBP	102.18%	490'499.76	0.17	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	338	0	0	338 GBP	77.54%	331'079.13	0.11	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	245	0	0	245 GBP	69.53%	215'192.74	0.07	a)
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	281	125	0	406 GBP	95.39%	489'235.76	0.17	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	262	0	60	202 GBP	87.87%	224'223.59	0.08	a)
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	313	0	0	313 GBP	91.14%	360'365.05	0.12	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	170	100	50	220 GBP	51.17%	142'209.11	0.05	a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	150	150	0	300 GBP	98.52%	373'366.17	0.13	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	113	220	0	333 GBP	89.22%	375'314.86	0.13	a)
GB00BPJKN53	4.6250 % UKT 4 5/8 01/31/34	0	260	0	260 GBP	105.65%	347'002.14	0.12	a)
GB00BPJJKP77	4.7500 % UKT 4 3/4 10/22/43	0	80	0	80 GBP	104.88%	105'991.73	0.04	a)
GB00BPSNB460	3.7500 % UKT 3 3/4 03/07/27	0	100	0	100 GBP	98.97%	125'023.85	0.04	a)
GB00BPSNBB36	4.3750 % UKT 4 3/8 07/31/54	0	100	0	100 GBP	99.32%	125'465.99	0.04	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	190	50	0	240 GBP	95.61%	289'870.40	0.10	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	214	0	100	114 GBP	96.63%	139'157.35	0.05	a)
GB00BYYMZX75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	190	0	0	190 GBP	65.63%	157'530.69	0.05	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	173	0	0	173 GBP	94.41%	206'330.11	0.07	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	220	0	0	220 GBP	75.69%	210'353.86	0.07	a)
GB							13'250'034.51	4.47	
IE000GVLBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	12	0	0	12 EUR	100.77%	13'059.73	0.00	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	90	50	140	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDP44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	100	0	0	100 EUR	93.58%	101'065.96	0.03	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	50	0	0	50 EUR	89.10%	48'113.79	0.02	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	100	0	0	100 EUR	92.36%	99'748.36	0.03	a)
IE00BH3SQ895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	110	0	0	110 EUR	92.98%	110'459.75	0.04	a)
IE00BH3SQB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	85	0	0	85 EUR	72.87%	66'894.37	0.02	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	100	0	0	100 EUR	99.00%	106'919.53	0.04	a)
IE00BKFVC345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	65	0	0	65 EUR	77.59%	54'467.94	0.02	a)
IE00BKFVC568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	50	50	0	100 EUR	92.73%	100'147.96	0.03	a)
IE00BKFVC899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	100	0	0	100 EUR	85.85%	92'717.59	0.03	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	86	0	0	86 EUR	82.76%	76'867.15	0.03	a)
IE00BMMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	75	0	0	75 EUR	82.39%	66'735.61	0.02	a)
IE00BMMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	90	0	50	40 EUR	68.08%	29'410.43	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	140	0	0	140 EUR	84.82%	128'247.28	0.04	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	130	0	0	130 EUR	96.27%	135'162.49	0.05	a)
IE00BV8C9883	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	40	50	0	90 EUR	87.40%	84'952.43	0.03	a)
IE							1'314'970.37	0.44	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	300	0	0	300 ILS	105.45%	86'346.01	0.03	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	250	0	0	250 ILS	109.55%	74'754.41	0.03	a)
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	300	0	0	300 ILS	96.91%	79'356.78	0.03	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	300	0	0	300 ILS	94.42%	77'312.37	0.03	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	230	0	0	230 ILS	85.29%	53'543.93	0.02	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	150	0	0	150 ILS	92.66%	37'938.80	0.01	a)
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	420	0	0	420 ILS	83.48%	95'697.93	0.03	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	250	0	0	250 ILS	96.31%	65'721.70	0.02	a)
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	200	0	0	200 ILS	69.80%	38'102.96	0.01	a)
IL0011806606	1.3000 % ILGOV 1.3 04/30/32 0432	0	230	0	230 ILS	79.84%	50'124.50	0.02	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	100	0	0	100 ILS	68.27%	18'633.38	0.01	a)
IL0011948028	3.7500 % ILGOV 3 3/4 02/28/29 0229	0	300	0	300 ILS	98.54%	80'690.83	0.03	a)
IL							758'223.60	0.26	
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	150	0	0	150 EUR	110.10%	178'359.60	0.06	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	260	50	0	310 EUR	111.43%	373'072.70	0.13	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	540	0	0	540 EUR	110.40%	643'861.63	0.22	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	390	0	0	390 EUR	116.83%	492'077.37	0.17	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	510	0	150	360 EUR	116.56%	453'183.29	0.15	a)
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	320	0	0	320 EUR	111.50%	385'352.67	0.13	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	391	0	0	391 EUR	102.21%	431'597.82	0.15	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	230	75	50	255 EUR	111.78%	307'851.78	0.10	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	260	50	310	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	170	100	0	270 EUR	111.74%	325'841.15	0.11	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	280	0	0	280 EUR	102.32%	309'420.37	0.10	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	249	0	0	249 EUR	106.53%	286'465.77	0.10	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	179	40	0	219 EUR	109.24%	258'361.49	0.09	a)
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	320	0	0	320 EUR	101.38%	350'367.74	0.12	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24 10Y	200	100	300	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	200	0	0	200 EUR	88.32%	190'763.88	0.06	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	200	50	0	250 EUR	97.83%	264'145.24	0.09	a)
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	310	0	0	310 EUR	87.88%	294'217.60	0.10	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	221	0	0	221 EUR	97.99%	233'871.96	0.08	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	200	0	0	200 EUR	80.14%	173'093.00	0.06	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	220	0	0	220 EUR	96.75%	229'874.61	0.08	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	180	0	0	180 EUR	84.92%	165'075.98	0.06	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	270	0	0	270 EUR	95.30%	277'893.58	0.09	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	115	0	0	115 EUR	75.56%	93'850.08	0.03	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	105	115	0	220 EUR	91.32%	216'980.12	0.07	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	230	0	0	230 EUR	97.29%	241'672.27	0.08	a)
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	200	0	0	200 EUR	90.70%	195'902.50	0.07	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	200	0	0	200 EUR	96.71%	208'881.88	0.07	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24 7Y	80	0	80	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	175	0	0	175 EUR	89.62%	169'371.61	0.06	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	285	0	0	285 EUR	96.04%	295'622.13	0.10	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	144	0	0	144 EUR	97.88%	152'216.09	0.05	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	321	0	0	321 EUR	98.55%	341'665.50	0.12	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	230	0	0	230 EUR	98.81%	245'445.44	0.08	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	170	0	0	170 EUR	96.80%	177'731.36	0.06	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	95	75	0	170 EUR	96.18%	176'585.70	0.06	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	270	0	0	270 EUR	99.05%	288'828.53	0.10	a)
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	107	100	0	207 EUR	97.67%	218'359.03	0.07	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	175	0	0	175 EUR	89.82%	169'755.27	0.06	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	320	0	0	320 EUR	89.66%	309'873.97	0.10	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	207	0	207	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	220	0	0	220 EUR	93.99%	223'319.26	0.08	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	206	0	50	156 EUR	74.16%	124'944.22	0.04	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	160	0	0	160 EUR	78.00%	134'781.68	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	190	0	0	190 EUR	86.66%	177'815.28	0.06	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	250	0	60	190 EUR	98.13%	201'363.93	0.07	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	255	0	0	255 EUR	99.98%	247'798.32	0.08	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	245	0	0	245 EUR	93.01%	246'108.67	0.08	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	229	0	0	229 EUR	95.17%	235'380.83	0.08	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	200	0	0	200 EUR	73.30%	158'322.98	0.05	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	285	0	0	285 EUR	84.87%	261'228.71	0.09	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	190	0	0	190 EUR	62.36%	127'958.05	0.04	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	190	0	0	190 EUR	71.21%	146'114.07	0.05	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	193	0	0	193 EUR	89.43%	186'404.99	0.06	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	230	0	0	230 EUR	82.19%	204'159.06	0.07	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	250	0	0	250 EUR	93.85%	253'396.59	0.09	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	159	0	0	159 EUR	64.78%	111'238.01	0.04	a)
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	65	0	0	65 EUR	62.69%	44'008.89	0.01	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	150	0	0	150 EUR	89.59%	145'135.16	0.05	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	210	0	0	210 EUR	83.66%	189'746.85	0.06	a)
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	195	0	0	195 EUR	92.97%	195'783.43	0.07	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	100	100	0	200 EUR	82.48%	178'147.38	0.06	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	200	0	0	200 EUR	87.87%	189'791.89	0.06	a)
IT0005474330	0.0000 % BTPS 0 12/15/24 3Y	180	0	180	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	100	0	0	100 EUR	68.10%	73'552.00	0.02	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	150	0	0	150 EUR	94.27%	152'708.63	0.05	a)
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	150	0	0	150 EUR	97.08%	157'270.53	0.05	a)
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	250	0	0	250 EUR	92.73%	250'359.10	0.08	a)
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	150	0	0	150 EUR	98.08%	158'887.28	0.05	a)
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	135	0	0	135 EUR	93.08%	135'704.21	0.05	a)
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	192	0	0	192 EUR	98.43%	204'111.84	0.07	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	137	0	0	137 EUR	102.82%	152'136.24	0.05	a)
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	139	0	0	139 EUR	100.36%	150'661.27	0.05	a)
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	0	200	0	200 EUR	106.66%	230'393.23	0.08	a)
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	181	0	0	181 EUR	101.00%	197'430.02	0.07	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	105	0	0	105 EUR	104.73%	118'757.63	0.04	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	78	80	0	158 EUR	105.37%	179'794.05	0.06	a)
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	206	0	0	206 EUR	101.12%	224'977.46	0.08	a)
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	105	0	0	105 EUR	104.12%	118'070.43	0.04	a)
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	200	0	0	200 EUR	102.15%	220'634.39	0.07	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	100	120	0	220 EUR	106.07%	252'016.46	0.09	a)
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	50	150	0	200 EUR	102.55%	221'511.35	0.07	a)
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	50	200	0	250 EUR	101.58%	274'256.69	0.09	a)
IT0005557084	3.6000 % BTPS 3.6 09/29/25 2Y	0	200	0	200 EUR	100.30%	216'636.25	0.07	a)
IT0005560948	4.2000 % BTPS 4.2 03/01/34 10Y	0	225	0	225 EUR	104.83%	254'734.71	0.09	a)
IT0005561888	4.0000 % BTPS 4 11/15/30 7Y	0	155	0	155 EUR	103.94%	173'992.21	0.06	a)
IT0005566408	4.1000 % BTPS 4.1 02/01/29 5Y	0	100	0	100 EUR	104.05%	112'368.11	0.04	a)
IT0005580045	2.9500 % BTPS 2.95 02/15/27 3Y	0	100	0	100 EUR	99.46%	107'412.01	0.04	a)
IT0005580094	3.5000 % BTPS 3 1/2 02/15/31 7Y	0	120	0	120 EUR	100.77%	130'601.23	0.04	a)
IT0005582421	4.1500 % BTPS 4.15 10/01/39 15Y	0	110	0	110 EUR	101.68%	120'794.12	0.04	a)
IT							18'700'210.41	6.31	
JP1024421NB7	0.0050 % JGB 0.005 11/01/24 442	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024441P12	0.0050 % JGB 0.005 01/01/25 444	35'000	0	35'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024451P27	0.0050 % JGB 0.005 02/01/25 445	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	23'000	0	23'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024471P49	0.0050 % JGB 0.005 04/01/25 447	27'000	0	0	27'000 JPY	99.95%	178'312.92	0.06	a)
JP1024481P54	0.0050 % JGB 0.005 05/01/25 448	25'000	0	0	25'000 JPY	99.95%	165'099.60	0.06	a)
JP1024491P60	0.0050 % JGB 0.005 06/01/25 449	30'000	0	0	30'000 JPY	99.93%	198'087.81	0.07	a)
JP1024501P76	0.0050 % JGB 0.005 07/01/25 450	10'000	0	0	10'000 JPY	99.92%	66'018.04	0.02	a)
JP1024521P98	0.0050 % JGB 0.005 09/01/25 452	0	50'000	0	50'000 JPY	99.88%	329'958.04	0.11	a)
JP1024531PA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/25 453	0	35'000	0	35'000 JPY	99.85%	230'922.06	0.08	a)
JP1024561Q15	0.1000 % JGB 0.1 01/01/26 456	0	15'000	0	15'000 JPY	99.87%	98'985.43	0.03	a)
JP1024571Q21	0.1000 % JGB 0.1 02/01/26 457	0	30'000	0	30'000 JPY	99.85%	197'927.25	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	20'000	0	0	20'000 JPY	100.02%	132'169.54	0.04	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	20'000	0	0	20'000 JPY	99.92%	132'038.72	0.04	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	30'000	0	10'000	20'000 JPY	99.66%	131'699.10	0.04	a)
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	20'000	0	0	20'000 JPY	99.54%	131'539.20	0.04	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	25'000	0	0	25'000 JPY	99.50%	164'364.53	0.06	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	20'000	0	0	20'000 JPY	99.41%	131'367.40	0.04	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	20'000	0	15'000	5'000 JPY	99.69%	32'934.68	0.01	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	10'000	0	0	10'000 JPY	99.34%	65'636.13	0.02	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	35'000	0	0	35'000 JPY	99.59%	230'302.28	0.08	a)
JP1051561P27	0.2000 % JGB 0.2 12/20/27 156	48'000	0	0	48'000 JPY	99.82%	316'597.97	0.11	a)
JP1051571P41	0.2000 % JGB 0.2 03/20/28 157	27'000	0	0	27'000 JPY	99.74%	177'938.28	0.06	a)
JP1051581P56	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 158	50'000	0	0	50'000 JPY	99.35%	328'216.98	0.11	a)
JP1051591P70	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 159	10'000	0	0	10'000 JPY	99.24%	65'573.36	0.02	a)
JP1051621PA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/28 162	0	35'000	0	35'000 JPY	99.92%	231'083.94	0.08	a)
JP1051631PB2	0.4000 % JGB 0.4 09/20/28 163	0	20'000	0	20'000 JPY	100.37%	132'630.74	0.04	a)
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	62'000	0	15'000	47'000 JPY	100.41%	311'809.57	0.11	a)
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	0	20'000	0	20'000 JPY	100.46%	132'754.96	0.04	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	10'000	0	0	10'000 JPY	99.85%	65'973.11	0.02	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	10'000	0	0	10'000 JPY	99.81%	65'949.32	0.02	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	22'000	0	0	22'000 JPY	99.77%	145'033.27	0.05	a)
JP1103451GCO	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	32'500	0	0	32'500 JPY	99.76%	214'227.92	0.07	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	25'000	0	0	25'000 JPY	99.69%	164'673.42	0.06	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	50'500	0	0	50'500 JPY	99.64%	332'480.15	0.11	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	10'000	0	0	10'000 JPY	99.59%	65'800.65	0.02	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	30'000	0	0	30'000 JPY	99.46%	197'142.29	0.07	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	15'000	0	0	15'000 JPY	99.35%	98'465.09	0.03	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	25'000	0	0	25'000 JPY	99.24%	163'933.39	0.06	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	15'000	0	0	15'000 JPY	99.04%	98'159.83	0.03	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	13'000	0	0	13'000 JPY	98.87%	84'925.83	0.03	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	14'000	0	0	14'000 JPY	98.73%	91'332.78	0.03	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	20'000	0	0	20'000 JPY	98.60%	130'298.32	0.04	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	11'000	0	0	11'000 JPY	98.42%	71'534.70	0.02	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	15'000	0	15'000 JPY	98.27%	97'398.66	0.03	a)
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	11'000	0	0	11'000 JPY	98.15%	71'337.01	0.02	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	10'000	0	0	10'000 JPY	97.96%	64'724.30	0.02	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	5'000	0	0	5'000 JPY	97.76%	32'296.41	0.01	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	23'000	0	15'000	8'000 JPY	97.55%	51'564.83	0.02	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	32'000	0	15'000	17'000 JPY	97.38%	109'386.56	0.04	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	20'000	0	0	20'000 JPY	97.06%	128'265.88	0.04	a)
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	10'000	0	0	10'000 JPY	99.15%	65'513.89	0.02	a)
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	27'000	0	0	27'000 JPY	98.96%	176'537.84	0.06	a)
JP1103711P74	0.4000 % JGB 0.4 06/20/33 371	17'000	15'000	0	32'000 JPY	97.86%	206'910.56	0.07	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	52'500	0	52'500 JPY	101.17%	350'941.22	0.12	a)
JP1103731Q12	0.6000 % JGB 0.6 12/20/33 373	0	52'000	0	52'000 JPY	99.07%	340'397.36	0.11	a)
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	25'000	0	0	25'000 JPY	103.19%	170'459.87	0.06	a)
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	20'000	0	0	20'000 JPY	103.80%	137'175.33	0.05	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	12'000	0	0	12'000 JPY	104.20%	82'617.59	0.03	a)
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	10'000	0	0	10'000 JPY	104.71%	69'188.94	0.02	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	13'000	0	0	13'000 JPY	104.98%	90'174.96	0.03	a)
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	16'000	0	0	16'000 JPY	105.19%	111'205.52	0.04	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	11'000	0	0	11'000 JPY	105.64%	76'777.96	0.03	a)
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	10'000	0	0	10'000 JPY	106.73%	70'519.67	0.02	a)
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	20'000	0	0	20'000 JPY	106.84%	141'184.71	0.05	a)
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	0	21'000	0	21'000 JPY	106.88%	148'307.77	0.05	a)
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	15'000	0	0	15'000 JPY	107.65%	106'694.31	0.04	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	10'000	0	0	10'000 JPY	108.90%	71'952.16	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	12'000	0	0	12'000 JPY	107.92%	85'569.52	0.03	a)
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	10'000	0	0	10'000 JPY	108.36%	71'599.99	0.02	a)
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	15'000	0	0	15'000 JPY	108.23%	107'265.19	0.04	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	10'000	0	0	10'000 JPY	107.30%	70'894.31	0.02	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	11'000	0	0	11'000 JPY	107.59%	78'194.52	0.03	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	12'000	0	0	12'000 JPY	108.56%	86'078.56	0.03	a)
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	0	20'000	0	20'000 JPY	109.48%	144'676.07	0.05	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	14'000	0	0	14'000 JPY	108.97%	100'798.70	0.03	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	10'000	0	0	10'000 JPY	109.37%	72'262.05	0.02	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	15'000	0	0	15'000 JPY	109.76%	108'781.59	0.04	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	10'000	0	0	10'000 JPY	110.32%	72'891.74	0.02	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	10'000	0	0	10'000 JPY	110.72%	73'160.00	0.02	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	20'000	0	0	20'000 JPY	110.14%	145'546.93	0.05	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	10'000	0	0	10'000 JPY	109.83%	72'565.99	0.02	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	9'000	0	0	9'000 JPY	108.61%	64'585.68	0.02	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	10'000	0	0	10'000 JPY	107.33%	70'915.46	0.02	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	12'000	0	0	12'000 JPY	109.45%	86'778.68	0.03	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	9'000	0	0	9'000 JPY	108.82%	64'708.78	0.02	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	15'000	0	0	15'000 JPY	111.04%	110'057.15	0.04	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	15'000	0	0	15'000 JPY	110.39%	109'407.97	0.04	a)
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	15'000	0	0	15'000 JPY	111.97%	110'972.94	0.04	a)
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	10'000	0	0	10'000 JPY	110.61%	73'087.32	0.02	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	25'500	0	0	25'500 JPY	110.12%	185'531.89	0.06	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	34'500	0	0	34'500 JPY	109.55%	249'723.51	0.08	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	53'000	0	0	53'000 JPY	109.67%	384'067.45	0.13	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	20'000	0	0	20'000 JPY	109.10%	144'169.94	0.05	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	17'000	0	0	17'000 JPY	108.25%	121'590.80	0.04	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	15'000	0	0	15'000 JPY	107.54%	106'585.28	0.04	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	28'500	0	0	28'500 JPY	109.29%	205'805.61	0.07	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	31'000	0	0	31'000 JPY	109.29%	223'848.49	0.08	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	11'000	0	0	11'000 JPY	110.21%	80'100.23	0.03	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	17'000	0	0	17'000 JPY	108.58%	121'967.09	0.04	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	12'000	0	0	12'000 JPY	107.64%	85'345.93	0.03	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	26'500	0	0	26'500 JPY	109.47%	191'671.28	0.06	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	26'000	0	0	26'000 JPY	109.48%	188'084.04	0.06	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	17'000	0	0	17'000 JPY	108.48%	121'846.90	0.04	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	25'000	0	0	25'000 JPY	107.51%	177'587.63	0.06	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	20'000	0	0	20'000 JPY	107.44%	141'974.96	0.05	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	22'500	0	0	22'500 JPY	106.47%	158'281.24	0.05	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	27'000	0	0	27'000 JPY	104.36%	186'171.46	0.06	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	21'000	0	0	21'000 JPY	104.18%	144'548.88	0.05	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	20'000	0	0	20'000 JPY	105.13%	138'923.65	0.05	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	20'000	0	0	20'000 JPY	103.90%	137'299.54	0.05	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	23'000	0	0	23'000 JPY	101.56%	154'342.92	0.05	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	15'000	0	0	15'000 JPY	94.60%	93'756.32	0.03	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	10'000	20'000	15'000	15'000 JPY	91.94%	91'117.97	0.03	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	18'000	20'000	15'000	23'000 JPY	95.07%	144'473.95	0.05	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	20'000	0	0	20'000 JPY	95.95%	126'795.07	0.04	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	25'000	0	0	25'000 JPY	96.85%	159'987.11	0.05	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	25'000	0	0	25'000 JPY	95.23%	157'312.76	0.05	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	22'000	0	0	22'000 JPY	94.86%	137'885.75	0.05	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	15'000	25'000	15'000	25'000 JPY	94.49%	156'088.73	0.05	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	30'000	0	0	30'000 JPY	92.89%	184'134.92	0.06	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	30'000	0	0	30'000 JPY	92.50%	183'345.99	0.06	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	21'000	0	0	21'000 JPY	94.81%	131'547.46	0.04	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	25'000	0	0	25'000 JPY	91.79%	151'623.77	0.05	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	22'000	0	0	22'000 JPY	89.98%	130'792.03	0.04	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	37'000	0	7'000	30'000 JPY	88.29%	175'006.77	0.06	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	10'000	21'000	5'000	26'000 JPY	87.76%	150'762.03	0.05	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	40'000	0	0	40'000 JPY	87.34%	230'839.47	0.08	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	35'000	0	0	35'000 JPY	88.36%	204'343.38	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	35'000	0	0	35'000 JPY	87.95%	203'397.53	0.07	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	43'000	0	0	43'000 JPY	87.54%	248'703.62	0.08	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	40'000	0	0	40'000 JPY	88.61%	234'182.82	0.08	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	40'000	0	0	40'000 JPY	88.20%	233'104.49	0.08	a)
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	47'000	0	0	47'000 JPY	86.16%	267'559.48	0.09	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	45'000	0	0	45'000 JPY	87.25%	259'423.83	0.09	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	40'000	0	0	40'000 JPY	86.96%	229'827.21	0.08	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	45'000	0	0	45'000 JPY	91.34%	271'587.76	0.09	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	35'000	0	0	35'000 JPY	92.67%	214'315.30	0.07	a)
JP1201821NA5	1.1000 % JGB 1.1 09/20/42 182	33'000	12'000	7'500	37'500 JPY	95.63%	236'957.77	0.08	a)
JP1201831P14	1.4000 % JGB 1.4 12/20/42 183	30'000	0	0	30'000 JPY	100.31%	198'835.11	0.07	a)
JP1201841P46	1.1000 % JGB 1.1 03/20/43 184	29'500	0	0	29'500 JPY	95.06%	185'289.90	0.06	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	15'000	30'000	7'500	37'500 JPY	94.69%	234'626.18	0.08	a)
JP1201861PA6	1.5000 % JGB 1 1/2 09/20/43 186	0	50'000	0	50'000 JPY	101.29%	334'642.70	0.11	a)
JP1201871Q14	1.3000 % JGB 1.3 12/20/43 187	0	20'000	0	20'000 JPY	97.59%	128'967.59	0.04	a)
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	7'000	0	0	7'000 JPY	109.47%	50'630.15	0.02	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	10'000	0	0	10'000 JPY	112.23%	74'155.74	0.03	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	10'000	0	0	10'000 JPY	116.12%	76'726.02	0.03	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	15'000	0	0	15'000 JPY	117.30%	116'255.57	0.04	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	10'000	0	0	10'000 JPY	117.51%	77'645.77	0.03	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	10'000	0	0	10'000 JPY	116.72%	77'123.13	0.03	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	15'000	0	0	15'000 JPY	115.76%	114'727.28	0.04	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	10'000	0	0	10'000 JPY	115.90%	76'582.64	0.03	a)
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	10'000	0	0	10'000 JPY	118.15%	78'063.36	0.03	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	9'400	0	0	9'400 JPY	116.04%	72'071.53	0.02	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	10'000	0	0	10'000 JPY	118.45%	78'265.55	0.03	a)
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	15'000	0	0	15'000 JPY	118.47%	117'419.14	0.04	a)
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	15'000	10'000	15'000	10'000 JPY	118.59%	78'359.38	0.03	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	10'000	0	0	10'000 JPY	116.43%	76'928.87	0.03	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	20'000	0	0	20'000 JPY	117.52%	155'302.12	0.05	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	15'000	0	0	15'000 JPY	118.88%	117'822.52	0.04	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	20'000	0	0	20'000 JPY	118.89%	157'115.20	0.05	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	20'000	0	0	20'000 JPY	117.61%	155'414.45	0.05	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	12'000	15'000	0	27'000 JPY	116.20%	207'297.63	0.07	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	30'000	0	6'000	24'000 JPY	114.66%	181'817.70	0.06	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	30'000	0	0	30'000 JPY	116.03%	230'005.61	0.08	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	35'000	0	0	35'000 JPY	111.30%	257'385.11	0.09	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	28'000	0	0	28'000 JPY	114.18%	211'241.86	0.07	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	36'300	0	0	36'300 JPY	110.62%	265'309.35	0.09	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	35'000	0	0	35'000 JPY	110.47%	255'472.59	0.09	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	44'500	0	0	44'500 JPY	108.82%	319'969.53	0.11	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	25'000	0	0	25'000 JPY	106.78%	176'386.73	0.06	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	18'500	0	0	18'500 JPY	108.18%	132'233.83	0.04	a)
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	15'000	0	0	15'000 JPY	106.36%	105'415.77	0.04	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	15'000	0	0	15'000 JPY	104.36%	103'434.53	0.03	a)
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	15'000	0	0	15'000 JPY	104.21%	103'279.92	0.03	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	10'000	0	0	10'000 JPY	104.12%	68'797.12	0.02	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	17'000	0	0	17'000 JPY	104.03%	116'856.25	0.04	a)
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	10'000	0	0	10'000 JPY	100.28%	66'258.55	0.02	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	20'000	0	0	20'000 JPY	100.16%	132'353.23	0.04	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	10'000	0	0	10'000 JPY	101.81%	67'269.48	0.02	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	10'000	0	0	10'000 JPY	98.05%	64'783.77	0.02	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	5'000	5'000	0	10'000 JPY	97.83%	64'639.07	0.02	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	20'000	0	0	20'000 JPY	86.49%	114'289.87	0.04	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	12'000	0	0	12'000 JPY	76.81%	60'904.29	0.02	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	19'500	0	0	19'500 JPY	80.20%	103'338.60	0.03	a)
JP1300531GCO	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	15'500	0	0	15'500 JPY	81.78%	83'752.95	0.03	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	12'000	0	0	12'000 JPY	85.39%	67'702.53	0.02	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	13'000	0	0	13'000 JPY	85.16%	73'152.00	0.02	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	15'000	0	0	15'000 JPY	84.87%	84'111.80	0.03	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	15'000	0	0	15'000 JPY	84.64%	83'889.79	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	19'000	0	0	19'000 JPY	84.34%	105'883.77	0.04	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	22'000	13'000	11'000	24'000 JPY	82.13%	130'240.18	0.04	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	15'000	0	0	15'000 JPY	85.90%	85'136.61	0.03	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	20'000	0	0	20'000 JPY	81.59%	107'814.59	0.04	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	10'000	10'000	0	20'000 JPY	77.16%	101'959.10	0.03	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	27'000	0	5'000	22'000 JPY	74.66%	108'528.19	0.04	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	17'000	0	0	17'000 JPY	74.33%	83'487.53	0.03	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	30'000	0	0	30'000 JPY	74.06%	146'803.66	0.05	a)
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	0	15'000	0	15'000 JPY	73.66%	73'009.35	0.02	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	20'000	0	0	20'000 JPY	77.49%	102'401.80	0.03	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	38'000	0	0	38'000 JPY	77.17%	193'764.97	0.07	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	32'000	0	0	32'000 JPY	79.05%	167'134.95	0.06	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	35'000	0	0	35'000 JPY	78.81%	182'253.46	0.06	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	35'000	0	0	35'000 JPY	78.57%	181'703.06	0.06	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	30'000	0	0	30'000 JPY	78.26%	155'127.02	0.05	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	20'000	13'650	0	33'650 JPY	78.02%	173'473.87	0.06	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	20'000	15'000	0	35'000 JPY	84.40%	195'171.62	0.07	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	31'200	0	0	31'200 JPY	90.92%	187'439.13	0.06	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	32'500	0	0	32'500 JPY	93.06%	199'840.26	0.07	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	25'000	0	0	25'000 JPY	97.53%	161'100.46	0.05	a)
JP1300781P48	1.4000 % JGB 1.4 03/20/53 78	30'850	0	0	30'850 JPY	92.80%	189'152.32	0.06	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	10'000	25'000	0	35'000 JPY	88.35%	204'324.88	0.07	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	0	20'000	0	20'000 JPY	101.72%	134'420.03	0.05	a)
JP1300811Q17	1.6000 % JGB 1.6 12/20/53 81	0	18'000	0	18'000 JPY	96.88%	115'224.02	0.04	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	10'000	0	0	10'000 JPY	116.22%	76'792.76	0.03	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	10'000	0	0	10'000 JPY	112.04%	74'026.23	0.02	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	28'000	0	20'000	8'000 JPY	111.64%	59'010.60	0.02	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	21'000	0	0	21'000 JPY	111.31%	154'443.55	0.05	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	25'000	0	5'000	20'000 JPY	106.68%	140'977.23	0.05	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	13'000	0	0	13'000 JPY	104.36%	89'637.25	0.03	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	15'000	0	0	15'000 JPY	99.16%	98'278.77	0.03	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	15'000	0	0	15'000 JPY	91.80%	90'988.14	0.03	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	28'000	0	0	28'000 JPY	66.92%	123'809.04	0.04	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	30'000	0	5'000	25'000 JPY	78.55%	129'748.25	0.04	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	24'000	0	0	24'000 JPY	75.27%	119'368.06	0.04	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	27'000	0	0	27'000 JPY	66.59%	118'803.92	0.04	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	45'000	0	0	45'000 JPY	65.85%	195'803.29	0.07	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	42'900	0	0	42'900 JPY	70.11%	198'743.97	0.07	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	33'000	10'000	0	43'000 JPY	77.06%	218'942.15	0.07	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	15'450	21'000	0	36'450 JPY	84.35%	203'156.16	0.07	a)
JP							32'126'816.62	10.85	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	30'000	0	30'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	6'000	0	0	6'000 MXN	105.58%	38'110.95	0.01	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	38'000	0	0	38'000 MXN	94.68%	216'463.74	0.07	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	30'000	0	0	30'000 MXN	96.97%	175'020.71	0.06	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	25'000	0	0	25'000 MXN	93.30%	140'328.72	0.05	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	46'850	0	0	46'850 MXN	92.14%	259'701.40	0.09	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	32'500	0	0	32'500 MXN	85.25%	166'680.47	0.06	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	10'250	0	0	10'250 MXN	89.74%	55'337.80	0.02	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	50'000	0	0	50'000 MXN	92.48%	278'196.62	0.09	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	32'650	0	0	32'650 MXN	86.61%	170'122.82	0.06	a)
MX0MGO000193	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	9'000	10'000	0	19'000 MXN	93.94%	107'385.43	0.04	a)
MX0MGO000180	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	21'000	0	6'000	15'000 MXN	95.07%	85'796.48	0.03	a)
MX0MGO0001C8	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	32'000	9'000	0	41'000 MXN	89.97%	221'928.15	0.07	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	23'200	10'000	0	33'200 MXN	89.28%	178'328.46	0.06	a)
MX0MGO0001E4	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	15'000	11'000	0	26'000 MXN	85.63%	133'942.92	0.05	a)
MX0MGO0001F1	8.5000 % MBONO 8 1/2 03/01/29 M	0	15'000	0	15'000 MXN	96.91%	87'451.92	0.03	a)
MXMSG0000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	0	5'000	0	5'000 MXN	91.32%	27'470.42	0.01	a)
MX							2'342'267.01	0.79	
MYBML1700020	4.0590 % MGS 4.059 09/30/24 0217	400	0	400	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	500	0	0	500 MYR	100.82%	106'506.44	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	300	0	0	300 MYR	101.23%	64'166.28	0.02	a)
MYBMO2000028	2.6320 % MGS 2.632 04/15/31 0220	500	0	0	500 MYR	92.98%	98'225.22	0.03	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	400	0	0	400 MYR	98.11%	82'913.16	0.03	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200 MYR	100.50%	42'468.62	0.01	a)
MYBMS1900047	3.8280 % MGS 3.828 07/05/34 0419	500	0	0	500 MYR	99.62%	105'241.92	0.04	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	400	0	0	400 MYR	106.26%	89'801.82	0.03	a)
MYBMX0700034	3.5020 % MGS 3.502 05/31/27 0307	650	0	0	650 MYR	100.01%	137'347.35	0.05	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	500	0	0	500 MYR	103.99%	109'855.27	0.04	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	300	0	0	300 MYR	107.98%	68'443.48	0.02	a)
MYBMY1900052	3.7570 % MGS 3.757 05/22/40 0519	200	0	0	200 MYR	96.84%	40'922.88	0.01	a)
MYBMY2200023	4.6960 % MGS 4.696 10/15/42 0222	450	0	0	450 MYR	108.13%	102'810.69	0.03	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	140	0	0	140 MYR	108.20%	32'005.66	0.01	a)
MYBMZ1800051	4.9210 % MGS 4.921 07/06/48 0518	205	0	0	205 MYR	111.29%	48'204.67	0.02	a)
MYBMZ2000016	4.0650 % MGS 4.065 06/15/50 0120	355	0	0	355 MYR	98.07%	73'553.93	0.02	a)
MY							1'202'467.39	0.41	
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	175	30	0	205 EUR	114.32%	253'103.37	0.09	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	140	0	0	140 EUR	110.37%	166'878.71	0.06	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	193	40	50	183 EUR	114.78%	226'850.19	0.08	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	190	0	0	190 EUR	99.76%	204'706.62	0.07	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	222	0	0	222 EUR	101.40%	243'115.57	0.08	a)
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	98	150	50	198 EUR	96.38%	206'098.09	0.07	a)
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	210	0	0	210 EUR	95.03%	215'527.09	0.07	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	205	0	0	205 EUR	94.31%	208'801.42	0.07	a)
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	217	0	0	217 EUR	92.90%	217'719.48	0.07	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	100	50	0	150 EUR	89.05%	144'260.37	0.05	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	182	0	0	182 EUR	72.18%	141'876.38	0.05	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	157	0	0	157 EUR	85.69%	145'295.32	0.05	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	150	40	0	190 EUR	83.60%	171'546.45	0.06	a)
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	120	0	0	120 EUR	69.21%	89'695.77	0.03	a)
NL0015000L58	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	140	0	0	140 EUR	88.81%	134'280.13	0.05	a)
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	150	0	0	150 EUR	95.01%	153'907.42	0.05	a)
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	165	0	0	165 EUR	85.02%	151'504.97	0.05	a)
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	85	0	0	85 EUR	86.71%	79'599.43	0.03	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	80	50	0	130 EUR	99.52%	139'725.47	0.05	a)
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	75	0	0	75 EUR	99.95%	80'959.14	0.03	a)
NL0015001RG8	3.2500 % NETHER 3 1/4 01/15/44	0	75	0	75 EUR	108.37%	87'776.07	0.03	a)
NL0015001XZ6	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/34	0	90	0	90 EUR	99.12%	96'344.22	0.03	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	175	0	0	175 EUR	93.00%	175'769.23	0.06	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	218	0	0	218 EUR	49.31%	116'094.95	0.04	a)
NL							3'851'435.86	1.30	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	600	0	600	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	700	0	0	700 NOK	95.80%	61'817.01	0.02	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	450	0	0	450 NOK	94.81%	39'327.19	0.01	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	500	0	0	500 NOK	94.06%	43'351.21	0.01	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	350	0	0	350 NOK	91.39%	29'484.45	0.01	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	530	0	0	530 NOK	87.98%	42'979.51	0.01	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	600	0	0	600 NOK	85.13%	47'082.02	0.02	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	350	0	0	350 NOK	89.90%	29'002.77	0.01	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	400	0	0	400 NOK	95.46%	35'196.06	0.01	a)
NO							328'240.22	0.11	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	80	0	0	80 NZD	97.56%	46'685.45	0.02	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	80	0	0	80 NZD	100.17%	47'931.31	0.02	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	80	0	0	80 NZD	93.78%	44'874.33	0.02	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	120	0	0	120 NZD	92.22%	66'191.98	0.02	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	60	0	0	60 NZD	80.55%	28'909.19	0.01	a)
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	60	0	0	60 NZD	91.78%	32'939.86	0.01	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	150	0	0	150 NZD	84.61%	75'917.72	0.03	a)
NZGOVDT530C2	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/30 0530	100	0	0	100 NZD	100.39%	60'050.94	0.02	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	60	0	0	60 NZD	82.03%	29'440.23	0.01	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	150	0	0	150 NZD	82.96%	74'438.18	0.03	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	40	0	0	40 NZD	97.05%	23'220.36	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	40	0	0	40 NZD	63.81%	15'267.74	0.01	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	50	0	0	50 NZD	68.05%	20'353.24	0.01	a)
NZ							566'220.53	0.19	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	600	0	0	600 PLN	101.74%	153'078.81	0.05	a)
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	400	0	0	400 PLN	91.18%	91'460.10	0.03	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	220	0	0	220 PLN	97.54%	53'811.80	0.02	a)
PL0000108866	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/26 0726	300	0	0	300 PLN	94.36%	70'987.40	0.02	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	750	0	0	750 PLN	91.98%	172'992.29	0.06	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	260	0	0	260 PLN	87.98%	57'362.67	0.02	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	750	0	0	750 PLN	95.51%	179'631.37	0.06	a)
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	630	250	0	880 PLN	77.92%	171'950.60	0.06	a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	850	0	0	850 PLN	88.45%	188'533.64	0.06	a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	450	400	0	850 PLN	76.63%	163'338.98	0.06	a)
PL0000115283	0.0000 % POLGB 0 10/25/25 1025	0	400	0	400 PLN	92.30%	92'583.54	0.03	a)
PL							1'395'731.20	0.47	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	750	0	0	750 SEK	111.86%	78'460.10	0.03	a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	400	0	0	400 SEK	99.41%	37'187.59	0.01	a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	750	0	0	750 SEK	99.21%	69'590.65	0.02	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	950	0	0	950 SEK	95.83%	85'139.81	0.03	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	450	0	0	450 SEK	93.55%	39'369.00	0.01	a)
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	750	0	0	750 SEK	91.81%	64'393.83	0.02	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	750	0	0	750 SEK	85.85%	60'216.88	0.02	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	500	0	0	500 SEK	94.52%	44'198.32	0.01	a)
SE							478'556.18	0.16	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	125	0	0	125 SGD	98.62%	91'341.88	0.03	a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	90	0	0	90 SGD	95.24%	63'512.15	0.02	a)
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	75	0	0	75 SGD	97.43%	54'143.82	0.02	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	130	0	0	130 SGD	91.31%	87'954.21	0.03	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	75	0	0	75 SGD	98.20%	54'571.72	0.02	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	65	0	0	65 SGD	96.02%	46'245.55	0.02	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	75	0	0	75 SGD	102.18%	56'783.49	0.02	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	100	0	0	100 SGD	99.06%	73'399.53	0.02	a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	165	0	0	165 SGD	100.85%	123'297.64	0.04	a)
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	100	0	0	100 SGD	98.71%	73'140.19	0.02	a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	65	0	0	65 SGD	95.06%	45'783.19	0.02	a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	50	0	0	50 SGD	91.39%	33'858.18	0.01	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	70	0	0	70 SGD	79.75%	41'364.11	0.01	a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	50	0	0	50 SGD	95.47%	35'369.74	0.01	a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	30	50	0	80 SGD	96.51%	57'208.06	0.02	a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	30	50	0	80 SGD	99.59%	59'033.79	0.02	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	70	0	0	70 SGD	90.47%	46'924.27	0.02	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	50	0	0	50 SGD	79.03%	29'279.05	0.01	a)
SG							1'073'210.57	0.36	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	65	0	0	65 USD	102.30%	66'492.97	0.02	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	200	0	0	200 USD	105.67%	211'343.76	0.07	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	70	0	0	70 USD	103.88%	72'712.50	0.02	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	80	0	0	80 USD	110.47%	88'375.00	0.03	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	77	0	0	77 USD	107.13%	82'486.25	0.03	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	125	0	0	125 USD	103.91%	129'882.81	0.04	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	100	0	50	50 USD	108.56%	54'281.25	0.02	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	100	0	0	100 USD	101.88%	101'875.00	0.03	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	100	0	0	100 USD	103.05%	103'046.88	0.03	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	80	0	0	80 USD	91.78%	73'425.00	0.02	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	150	0	0	150 USD	99.73%	149'601.57	0.05	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	200	0	60	140 USD	102.41%	143'368.75	0.05	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	100	100	0	200 USD	100.81%	201'625.00	0.07	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	150	0	0	150 USD	103.53%	155'296.88	0.05	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	100	100	0	200 USD	100.45%	200'906.24	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	150	0	0	150 USD	94.31%	141'468.75	0.05	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	140	0	0	140 USD	98.59%	138'031.25	0.05	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	150	0	0	150 USD	104.58%	156'867.18	0.05	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	118	0	0	118 USD	99.78%	117'741.88	0.04	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	152	0	30	122 USD	92.03%	112'278.13	0.04	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	140	0	0	140 USD	83.98%	117'578.13	0.04	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	150	0	0	150 USD	83.66%	125'484.38	0.04	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	170	0	0	170 USD	81.83%	139'107.80	0.05	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	200	0	30	170 USD	78.47%	133'396.88	0.05	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	250	0	0	250 USD	78.23%	195'585.95	0.07	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	230	0	0	230 USD	82.78%	190'396.88	0.06	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	320	0	0	320 USD	79.41%	254'100.00	0.09	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	255	0	0	255 USD	88.94%	226'790.63	0.08	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	318	0	50	268 USD	90.44%	242'372.50	0.08	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	230	75	0	305 USD	88.69%	270'496.88	0.09	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	250	0	0	250 USD	85.28%	213'203.13	0.07	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	340	0	0	340 USD	81.86%	278'321.89	0.09	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	280	0	0	280 USD	80.03%	224'087.50	0.08	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	340	0	0	340 USD	73.09%	248'518.75	0.08	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	183	0	0	183 USD	79.72%	145'885.31	0.05	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	210	100	0	310 USD	77.80%	241'170.33	0.08	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	130	0	0	130 USD	79.34%	103'146.88	0.03	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	280	0	0	280 USD	72.25%	202'300.00	0.07	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	280	0	0	280 USD	72.08%	201'818.74	0.07	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	352	0	0	352 USD	68.38%	240'680.00	0.08	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	140	100	0	240 USD	77.00%	184'800.00	0.06	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	360	0	0	360 USD	78.61%	282'993.77	0.10	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	250	0	0	250 USD	78.50%	196'250.00	0.07	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	350	50	0	400 USD	74.78%	299'125.00	0.10	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	395	0	0	395 USD	74.67%	294'953.93	0.10	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	300	300	100	500 USD	78.19%	390'937.50	0.13	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	450	0	0	450 USD	79.91%	359'578.13	0.12	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	464	0	0	464 USD	78.00%	361'920.00	0.12	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	485	0	0	485 USD	83.53%	405'126.56	0.14	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	510	0	0	510 USD	77.91%	397'321.88	0.13	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	490	295	270	515 USD	76.03%	391'560.94	0.13	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	490	0	0	490 USD	66.66%	326'615.63	0.11	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	444	0	0	444 USD	68.44%	303'862.50	0.10	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	555	0	0	555 USD	62.59%	347'395.31	0.12	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	645	0	0	645 USD	51.14%	329'857.00	0.11	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	780	0	0	780 USD	52.78%	411'693.75	0.14	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	480	0	0	480 USD	61.84%	296'850.00	0.10	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	510	0	0	510 USD	62.44%	318'431.25	0.11	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	720	0	0	720 USD	56.47%	406'575.00	0.14	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	630	0	0	630 USD	64.28%	404'971.88	0.14	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	805	0	0	805 USD	60.22%	484'760.94	0.16	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	714	0	0	714 USD	69.69%	497'568.75	0.17	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	850	0	0	850 USD	67.86%	576'804.73	0.19	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	618	0	0	618 USD	73.88%	456'547.50	0.15	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	750	0	0	750 USD	61.94%	464'531.25	0.16	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	810	150	0	960 USD	67.45%	647'549.95	0.22	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	745	0	0	745 USD	59.91%	446'301.56	0.15	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	680	0	0	680 USD	70.13%	476'850.00	0.16	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	680	0	0	680 USD	65.77%	447'206.22	0.15	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	536	0	0	536 USD	74.34%	398'482.50	0.13	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	649	0	0	649 USD	75.64%	490'907.62	0.17	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	455	0	0	455 USD	85.00%	386'750.00	0.13	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	690	110	100	700 USD	77.66%	543'593.75	0.18	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	407	0	0	407 USD	86.38%	351'546.25	0.12	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	685	0	0	685 USD	94.00%	643'900.00	0.22	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	407	0	0	407 USD	94.19%	383'343.13	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	688	0	0	688 USD	87.78%	603'935.00	0.20	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	410	0	0	410 USD	92.44%	378'993.75	0.13	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	680	0	0	680 USD	87.86%	597'443.78	0.20	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	450	0	0	450 USD	92.31%	415'406.25	0.14	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	0	700	0	700 USD	96.13%	672'875.00	0.23	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	75	500	100	475 USD	98.84%	469'507.81	0.16	a)
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	0	720	0	720 USD	106.73%	768'487.54	0.26	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	0	350	0	350 USD	103.75%	363'125.00	0.12	a)
US912810TX63	4.2500 % T 4 1/4 02/15/54	0	250	0	250 USD	98.34%	245'859.38	0.08	a)
US912810TZ12	4.5000 % T 4 1/2 02/15/44	0	170	0	170 USD	100.58%	170'982.80	0.06	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	650	0	0	650 USD	93.17%	605'617.22	0.20	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	500	0	0	500 USD	93.36%	466'796.90	0.16	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	80	0	80	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	540	0	0	540 USD	93.00%	502'200.00	0.17	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	270	0	270	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	320	0	320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	653	0	0	653 USD	94.39%	616'370.75	0.21	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	200	0	0	200 USD	97.69%	195'375.00	0.07	a)
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	350	0	0	350 USD	97.78%	342'234.38	0.12	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	695	0	0	695 USD	94.63%	657'643.75	0.22	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	0	100	0	100 USD	97.63%	97'625.00	0.03	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	740	0	0	740 USD	94.41%	698'606.25	0.24	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	220	0	0	220 USD	97.13%	213'675.00	0.07	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	240	0	0	240 USD	97.38%	233'700.00	0.08	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	200	0	0	200 USD	97.27%	194'531.24	0.07	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	646	0	0	646 USD	95.23%	615'214.09	0.21	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	250	0	0	250 USD	96.97%	242'421.88	0.08	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	250	0	0	250 USD	96.48%	241'210.95	0.08	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	280	0	0	280 USD	96.38%	269'850.00	0.09	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	650	0	0	650 USD	92.91%	603'890.63	0.20	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	300	0	0	300 USD	96.05%	288'140.64	0.10	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	250	100	0	350 USD	95.47%	334'140.63	0.11	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	210	0	0	210 USD	95.56%	200'681.25	0.07	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	530	300	130	700 USD	91.47%	640'281.25	0.22	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	260	0	0	260 USD	94.92%	246'796.89	0.08	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	250	0	0	250 USD	94.34%	235'859.38	0.08	a)
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	1'080	0	1'080	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	595	100	0	695 USD	96.22%	668'720.31	0.23	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	631	0	0	631 USD	96.05%	606'055.81	0.20	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	550	0	0	550 USD	94.55%	520'007.84	0.18	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	550	0	0	550 USD	93.98%	516'914.09	0.17	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	550	100	0	650 USD	93.88%	610'187.50	0.21	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	495	100	0	595 USD	94.13%	560'043.75	0.19	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	595	0	0	595 USD	94.08%	559'764.81	0.19	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	550	0	0	550 USD	96.89%	532'898.41	0.18	a)
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	150	0	0	150 USD	97.39%	146'085.93	0.05	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	200	0	0	200 USD	97.41%	194'812.50	0.07	a)
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	232	0	0	232 USD	94.13%	218'370.00	0.07	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	500	100	30	570 USD	87.75%	500'175.00	0.17	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	265	0	0	265 USD	92.81%	245'953.13	0.08	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	200	0	0	200 USD	93.25%	186'500.00	0.06	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	250	0	0	250 USD	93.06%	232'656.25	0.08	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	365	0	0	365 USD	88.03%	321'314.06	0.11	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	250	0	0	250 USD	92.88%	232'187.50	0.08	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	240	100	0	340 USD	93.06%	316'412.50	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	340	0	340	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	828	100	0	928 USD	92.20%	855'644.95	0.29	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	635	100	30	705 USD	85.94%	605'859.38	0.20	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	148	0	0	148 USD	91.03%	134'544.19	0.05	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	220	100	0	320 USD	89.45%	286'249.98	0.10	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	275	150	0	425 USD	95.17%	404'480.49	0.14	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	345	0	0	345 USD	88.81%	306'403.13	0.10	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	900	100	60	940 USD	80.75%	759'050.00	0.26	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	319	0	0	319 USD	88.55%	282'464.55	0.10	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	600	0	0	600 USD	94.69%	568'125.00	0.19	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	400	0	0	400 USD	88.33%	353'312.48	0.12	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	550	0	0	550 USD	94.39%	519'148.41	0.18	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	490	0	0	490 USD	94.05%	460'829.71	0.16	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	470	0	0	470 USD	87.69%	412'131.25	0.14	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	1'335	0	0	1'335 USD	80.06%	1'068'834.38	0.36	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	370	0	0	370 USD	87.83%	324'964.04	0.11	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	490	0	0	490 USD	93.75%	459'375.00	0.16	a)
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	520	0	0	520 USD	87.19%	453'375.00	0.15	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	565	0	0	565 USD	93.44%	527'921.88	0.18	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	580	0	0	580 USD	93.13%	540'125.00	0.18	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	508	0	0	508 USD	87.34%	443'531.56	0.15	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	1'268	0	0	1'268 USD	80.94%	1'026'287.50	0.35	a)
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	495	0	0	495 USD	87.53%	433'279.69	0.15	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	555	0	0	555 USD	93.02%	516'236.69	0.17	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	647	0	0	647 USD	87.28%	564'709.69	0.19	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	595	0	0	595 USD	92.75%	551'862.50	0.19	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	673	0	0	673 USD	92.45%	622'209.50	0.21	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	662	0	0	662 USD	87.48%	579'146.60	0.20	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	1'136	0	0	1'136 USD	82.00%	931'520.00	0.31	a)
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	668	0	0	668 USD	88.58%	591'701.84	0.20	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	650	0	0	650 USD	92.42%	600'742.22	0.20	a)
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	610	0	0	610 USD	88.84%	541'946.88	0.18	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	612	0	0	612 USD	92.66%	567'056.25	0.19	a)
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	609	0	0	609 USD	92.38%	562'563.75	0.19	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	670	0	0	670 USD	88.66%	593'996.88	0.20	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	1'125	0	0	1'125 USD	84.28%	948'164.06	0.32	a)
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	670	0	0	670 USD	88.47%	592'740.63	0.20	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	635	0	0	635 USD	92.13%	584'993.75	0.20	a)
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	620	0	0	620 USD	88.30%	547'440.66	0.18	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	600	0	0	600 USD	92.20%	553'218.72	0.19	a)
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	750	0	0	750 USD	91.38%	685'312.50	0.23	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	658	0	0	658 USD	87.14%	573'385.28	0.19	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	1'233	0	0	1'233 USD	81.44%	1'004'124.38	0.34	a)
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	650	0	0	650 USD	87.44%	568'343.75	0.19	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	650	0	0	650 USD	91.41%	594'140.63	0.20	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	656	0	0	656 USD	87.75%	575'640.00	0.19	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	650	0	0	650 USD	91.50%	594'750.00	0.20	a)
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	650	0	0	650 USD	88.09%	572'609.38	0.19	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	620	0	0	620 USD	91.83%	569'334.34	0.19	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	648	0	648	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	1'200	125	50	1'275 USD	81.69%	1'041'515.63	0.35	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	635	100	0	735 USD	91.94%	675'740.63	0.23	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	625	100	0	725 USD	88.44%	641'171.88	0.22	a)
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	585	0	585	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	650	100	50	700 USD	87.73%	614'140.66	0.21	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	643	100	0	743 USD	91.80%	682'050.82	0.23	a)
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	560	0	560	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	570	0	0	570 USD	89.19%	508'368.75	0.17	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	1'135	0	0	1'135 USD	84.44%	958'365.63	0.32	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	625	0	625	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	550	100	0	650 USD	89.59%	582'359.38	0.20	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	600	0	0	600 USD	93.03%	558'187.50	0.19	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	506	0	0	506 USD	91.64%	463'701.54	0.16	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	550	0	0	550 USD	94.67%	520'695.34	0.18	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	555	0	0	555 USD	97.59%	541'645.31	0.18	a)
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	475	0	0	475 USD	93.78%	445'460.94	0.15	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	527	150	0	677 USD	95.23%	644'736.75	0.22	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	1'100	200	150	1'150 USD	90.81%	1'044'343.75	0.35	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	460	0	0	460 USD	97.58%	448'859.35	0.15	a)
US91282CE561	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	455	0	0	455 USD	93.14%	423'789.82	0.14	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	520	0	0	520 USD	94.77%	492'781.22	0.17	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	535	0	0	535 USD	97.56%	521'959.38	0.18	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	431	0	0	431 USD	95.38%	411'066.25	0.14	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	506	0	0	506 USD	96.58%	488'685.29	0.16	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	465	0	0	465 USD	97.64%	454'028.88	0.15	a)
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	495	0	0	495 USD	94.97%	470'095.31	0.16	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	400	0	0	400 USD	92.38%	369'500.00	0.12	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	452	0	0	452 USD	97.70%	441'618.10	0.15	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	1'067	0	0	1'067 USD	89.70%	957'132.29	0.32	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	485	0	0	485 USD	96.06%	465'903.13	0.16	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	400	0	0	400 USD	94.66%	378'625.00	0.13	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	442	0	0	442 USD	98.13%	433'712.50	0.15	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	390	200	30	560 USD	98.23%	550'112.53	0.19	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	476	0	0	476 USD	99.22%	472'281.25	0.16	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	457	0	0	457 USD	99.17%	453'215.49	0.15	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	378	0	0	378 USD	98.81%	373'511.25	0.13	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	275	400	0	675 USD	99.20%	669'621.06	0.23	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	1'068	0	0	1'068 USD	99.33%	1'060'824.32	0.36	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	440	0	0	440 USD	99.55%	438'006.27	0.15	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	454	0	454	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	400	0	30	370 USD	98.19%	363'293.75	0.12	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	465	0	0	465 USD	98.41%	457'589.06	0.15	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	434	0	0	434 USD	98.77%	428'642.79	0.14	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	379	0	0	379 USD	98.19%	372'130.63	0.13	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	465	0	0	465 USD	98.41%	457'589.06	0.15	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	501	0	501	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	430	0	0	430 USD	98.56%	423'818.75	0.14	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	453	0	453	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	465	0	0	465 USD	97.06%	451'340.63	0.15	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	380	0	0	380 USD	96.22%	365'631.25	0.12	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	432	0	0	432 USD	98.75%	426'600.00	0.14	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	1'188	100	100	1'188 USD	94.72%	1'125'258.75	0.38	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	453	0	453	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	491	0	0	491 USD	98.84%	485'322.81	0.16	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	379	0	0	379 USD	98.81%	374'499.38	0.13	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	433	0	0	433 USD	99.92%	432'661.74	0.15	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	350	0	0	350 USD	96.81%	338'843.75	0.11	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	465	0	0	465 USD	97.48%	453'302.37	0.15	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	506	0	506	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	450	0	0	450 USD	98.27%	442'195.29	0.15	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	275	250	0	525 USD	98.81%	518'765.63	0.18	a)
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	380	0	30	350 USD	96.09%	336'328.13	0.11	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	465	0	0	465 USD	97.00%	451'050.00	0.15	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	430	0	0	430 USD	98.03%	421'534.38	0.14	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	1'200	0	0	1'200 USD	93.69%	1'124'250.00	0.38	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	350	120	0	470 USD	99.17%	466'107.84	0.16	a)
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	500	0	0	500 USD	97.47%	487'343.75	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	350	0	0	350 USD	97.38%	340'812.50	0.12	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	430	150	0	580 USD	99.03%	574'381.25	0.19	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	400	0	0	400 USD	97.36%	389'437.52	0.13	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	465	0	0	465 USD	98.89%	459'841.38	0.16	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	455	0	0	455 USD	99.63%	453'293.75	0.15	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	430	0	0	430 USD	99.84%	429'328.13	0.14	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	455	0	0	455 USD	99.81%	454'146.88	0.15	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	465	0	0	465 USD	99.41%	462'239.06	0.16	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	0	400	50	350 USD	98.72%	345'515.63	0.12	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	0	1'205	0	1'205 USD	97.38%	1'173'368.75	0.40	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	200	260	0	460 USD	99.61%	458'203.15	0.15	a)
US91282CHV63	5.0000 % T 5 08/31/25	0	600	0	600 USD	100.20%	601'218.72	0.20	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	0	500	0	500 USD	99.38%	496'875.00	0.17	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	0	700	0	700 USD	100.41%	702'843.75	0.24	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	0	600	0	600 USD	100.23%	601'406.28	0.20	a)
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	0	500	0	500 USD	102.19%	510'937.50	0.17	a)
US91282CJA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	0	700	0	700 USD	101.44%	710'062.50	0.24	a)
US91282CJB81	5.0000 % T 5 09/30/25	0	600	0	600 USD	100.23%	601'406.28	0.20	a)
US91282CJC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	0	600	0	600 USD	100.28%	601'687.50	0.20	a)
US91282CJE21	5.0000 % T 5 10/31/25	0	700	0	700 USD	100.28%	701'968.75	0.24	a)
US91282CJF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	0	700	0	700 USD	102.52%	717'609.34	0.24	a)
US91282CJG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	0	450	0	450 USD	103.66%	466'453.13	0.16	a)
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	0	1'200	0	1'200 USD	102.22%	1'226'625.00	0.41	a)
US91282CJK80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	0	700	0	700 USD	100.33%	702'296.84	0.24	a)
US91282CJL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	0	700	0	700 USD	100.16%	701'093.75	0.24	a)
US91282CJM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	0	440	0	440 USD	100.81%	443'575.00	0.15	a)
US91282CJN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	0	300	0	300 USD	100.55%	301'640.64	0.10	a)
US91282CJP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	0	100	0	100 USD	99.75%	99'750.00	0.03	a)
US91282CJQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	0	400	0	400 USD	97.22%	388'875.00	0.13	a)
US91282CJR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	0	450	0	450 USD	97.88%	440'437.50	0.15	a)
US91282CJS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	0	500	0	500 USD	99.19%	495'937.50	0.17	a)
US91282CJT99	4.0000 % T 4 01/15/27	0	700	0	700 USD	98.81%	691'687.50	0.23	a)
US91282CJV46	4.2500 % T 4 1/4 01/31/26	0	200	0	200 USD	99.22%	198'437.50	0.07	a)
US91282CJW29	4.0000 % T 4 01/31/29	0	600	0	600 USD	98.98%	593'906.28	0.20	a)
US91282CJX02	4.0000 % T 4 01/31/31	0	400	0	400 USD	98.70%	394'812.48	0.13	a)
US91282CJZ59	4.0000 % T 4 02/15/34	0	470	0	470 USD	98.34%	462'215.63	0.16	a)
US91282CKA89	4.1250 % T 4 1/8 02/15/27	0	500	0	500 USD	99.16%	495'781.25	0.17	a)

US **120'707'402.58** **40.75**

Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

22'948'091.73 **7.75**

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

22'948'091.73 **7.75**

CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	105'467	46'133	529	151'071 CNY	1'102.87	22'948'091.73	7.75	a)
--------------	----------------------------------	---------	--------	-----	-------------	----------	---------------	------	----

CH **22'948'091.73** **7.75**

Derivative Finanzinstrumente

0.00 **0.00**

Devisentermingeschäfte

CAD/USD	Verfall 08.11.2023	75'000	102'578		USD/CAD	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 13.11.2023	90'593	100'000		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 13.11.2023	333'977	300'000		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 13.11.2023	187'164	180'000		EUR/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 27.11.2023	44'276	50'000		CHF/USD	0.00	0.00
USD/EUR	Verfall 27.11.2023	110'413	120'000		EUR/USD	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 06.12.2023	110'794	150'000		USD/CAD	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 19.12.2023	37'394	50'000		USD/CAD	0.00	0.00
EUR/USD	Verfall 27.12.2023	658'501	600'000		USD/EUR	0.00	0.00
JPY/USD	Verfall 27.12.2023	313'389	45'000'000		USD/JPY	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.01.2024	323'001	300'000		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 04.01.2024	119'573	100'000		USD/CHF	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 22.03.2024	200'000	271'301		USD/CAD	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CAD Verfall 26.03.2024		299'092	220'000		CAD/USD	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		334'175	2'577'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		1'463'021	2'483'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		13'518'184	2'201'569'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		4'721'285	4'241'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		6'829'117	54'493'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		47'268'202	51'834'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2023		285'615	1'191'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		181'845	2'120'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		1'974'395	2'926'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		249'311	455'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		200'527	2'386'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		31'424'354	32'507'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.11.2023		475'294	2'277'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		441'549	660'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		12'520	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		2'000	1'169		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		70'000	8'780		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		3'000	2'013		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		2'665'000	16'374		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		1'833	2'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'000	4'444		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		7'971	12'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		87'533	96'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		6'110	49'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		2'000	3'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		3'223	25'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.11.2023		1'458	7'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		430'532	448'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		47'680	43'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		41'035	6'663'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		34'000	32'304		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		57'000	7'019		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		3'000	1'981		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'000	4'389		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		62'998	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		2'324'000	14'012		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		1'831	15'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		3'824	639'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		8'522	9'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		24'000	21'498		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		10'778	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		7'000	6'630		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		523'000	3'126		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		2'481'000	1'429'627		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		455'000	240'859		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		1'191'000	267'927		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		2'602'000	335'320		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		2'386'000	194'316		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		32'936'000	31'681'138		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.11.2023		17'789'000	896'742		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'276'000	4'722'243		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2023		54'430'000	6'746'054		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		2'203'359'000	13'240'866		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		2'120'000	172'674		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.11.2023		2'284'000	493'287		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.11.2023		663'000	440'371		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		51'990'000	47'316'099		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		2'932'000	1'921'926		CAD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		924'450	17'712'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		3'839	77'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		1'402'695	2'440'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		239'011	453'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		259'421	1'156'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		336'507	2'616'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		196'499	2'418'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		31'781'229	33'110'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		889'542	17'798'000		CHF/MXN	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		4'681'766	4'253'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		7'098'454	57'339'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		12'993'848	2'158'780'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		174'038	2'142'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		494'621	2'299'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		440'810	665'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		46'893'583	51'701'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		1'934'526	2'960'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		10'000	6'539		CAD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		80'317	73'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.12.2023		7'000	1'499		PLN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		113'429	125'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		8'000	4'624		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		11'730'000	70'837		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		63'000	3'171		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		167'000	159'891		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		201'000	25'789		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.12.2023		27'000	3'346		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		18'000	17'291		EUR/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		1'508	7'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		9'000	5'227		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		7'729'000	46'618		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		123'000	111'149		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		4'000	2'622		CAD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		24'201	22'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		5'558	45'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		28'629	32'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		9'316	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		2'065	16'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		1'605	3'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		3'237	15'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		1'610	7'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		2'655	4'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		305'000	15'493		MXN/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		20'757	3'460'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		1'316	16'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		18'000	17'322		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		31'000	34'376		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		47'676	387'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		29'000	18'979		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		19'835	161'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		35'677	5'983'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		174'812	182'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		1'295	6'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		2'451	48'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		3'452	6'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		279'642	312'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'198	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		60'585	55'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		316'636	485'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		21'580	167'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		726'351	658'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.12.2023		34'794	160'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		155'188	270'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		4'704'588	4'882'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.12.2023		1'078'887	8'729'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		16'430	31'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		11'925	147'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		13'870	167'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		6'796'743	7'546'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		100'441	1'970'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		1'916'869	321'860'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		18'643	80'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		30'487	46'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		7'000	6'761		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		389'000	2'303		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		30'000	26'713		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.12.2023		31'000	3'805		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		1'641'000	9'646		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		24'000	23'086		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		4'000	4'404		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		54'843	62'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		48'092	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		69'000	61'056		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		2'468'594'000	14'519'282		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		59'556'000	51'784'538		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.12.2023		66'603'000	8'109'581		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		2'601'000	215'805		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		3'410'000	2'186'833		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.12.2023		487'000	261'543		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.12.2023		2'480'000	540'412		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		37'990'000	36'041'113		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		5'026'000	5'532'319		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		2'598'000	330'570		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		2'715'000	1'565'279		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.12.2023		2'289'000	184'631		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		715'000	465'830		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		19'448'000	973'442		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		1'243'000	290'216		ILS/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		15'116'064	2'566'168'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		53'938'406	62'257'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		8'863'691	72'885'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		223'181	2'695'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		2'280'519	3'567'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.01.2024		272'963	510'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		544'349	2'510'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		37'547'738	39'662'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		5'876'266	5'356'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		345'327	2'719'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		1'640'085	2'852'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		191'144	2'376'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		481'746	741'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2024		1'023'735	20'630'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		305'266	1'311'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		162'503	171'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		9'000	5'186		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		12'000	7'701		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2024		216'000	26'393		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		9'103'000	53'823		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		17'000	18'698		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		707'895	813'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2024		73'000	3'640		MXN/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		29'194	134'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		132'073	140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		9'000	5'198		AUD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		277'509	46'901'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		12'000	1'519		DKK/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		45'649	195'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2024		127'000	6'359		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		79'861	655'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		6'000	3'861		CAD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		74'709	68'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		541'000	470'374		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		3'000	1'954		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		18'000	1'501		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		139'000	121'087		USD/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		2'822	13'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		87'727	93'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		76'261	12'817'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2024		4'930	99'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		355'000	44'934		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		50'000	28'845		AUD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		1'873	8'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		1'955	3'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		61'000	39'272		CAD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		29'664	27'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		44'050	361'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		25'000	16'184		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		24'000	26'379		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.01.2024		2'393	391'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		38'070	44'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		4'000	3'789		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		7'747	12'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		5'825	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		161'000	152'026		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		32'290	268'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		20'698	19'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		14'191'000	85'130		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	PLN/CHF Verfall 04.01.2024		1'953	9'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2024		3'721	74'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		148'755	173'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		1'721	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		7'475	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		2'537	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2024		12'342	105'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		202'476	218'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		119'579	143'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		2'352'000	293'318		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024	2'602'983'000		15'538'637		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		2'797'000	1'606'233		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.01.2024		2'666'000	570'596		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2024		2'376'000	196'875		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		5'436'000	5'832'284		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		40'119'000	37'296'628		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2024		1'514'000	353'852		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2024		20'603'000	1'023'924		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.01.2024		510'000	271'759		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		2'677'000	223'530		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2024		74'058'000	8'752'915		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		62'750'000	52'811'028		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		3'479'000	2'220'507		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		741'000	472'773		SGD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		313'369	2'517'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		15'904'616	2'660'351'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		1'680'650	2'933'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.02.2024		585'246	2'744'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		202'930	2'455'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		6'290'295	5'880'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		39'249'662	42'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2024		1'053'075	21'355'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2024		286'878	540'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		236'335	2'836'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		9'349'981	79'219'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		55'806'617	66'515'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		2'375'605	3'732'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		489'749	769'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.02.2024		162'000	19'243		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		16'975'000	100'930		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		36'000	38'656		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		26'000	3'237		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		390'000	361'964		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		251'000	213'376		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		15'000	8'569		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		5'000	3'185		CAD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		119'651	20'339'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		65'666	61'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		160'000	148'706		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		19'682	31'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		26'000	22'037		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		7'606	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		11'907	100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		162'000	151'386		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		720'000	618'249		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		1'700	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.02.2024		1'498'000	74'726		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		15'826'000	92'698		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		2'548	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		1'457'096	1'542'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		44'657	69'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		81'188	142'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		2'478'237	2'855'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		588'763	100'310'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		3'716	45'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		5'702	45'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		4'306	52'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.02.2024		79'510	367'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		184'902	168'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2024		65'728	1'299'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		287'132	2'383'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		99'933	155'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2024		4'765	9'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		1'244	15'000		CHF/SEK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		2'597	4'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2024		5'660	113'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		1'645	13'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		12'918	20'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.02.2024		3'438	16'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2024		20'032	165'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		86'000	74'879	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		35'292	32'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		9'147	16'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		63'000	59'439	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		25'791	4'393'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		961'000	5'603	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		2'000	2'196	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		15'000	14'063	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		19'000	16'396	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		842'000	540'539	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		2'500'000	205'125	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.02.2024		21'269'000	1'062'357	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		3'079'000	1'746'132	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		1'593'000	375'617	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		2'751'631'000	16'149'047	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		3'937'000	2'527'987	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		2'549'000	318'701	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		43'052'000	40'118'006	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		68'268'000	58'566'435	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.02.2024		81'705'000	9'769'467	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		2'903'000	241'065	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.02.2024		3'127'000	673'487	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2024		549'000	289'916	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		6'110'000	6'674'870	GBP/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		362'769	1'557'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		6'492	28'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		1'855	8'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		531'134	829'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		201'892	2'467'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		1'037'300	20'946'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		1'689'871	2'987'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		2'461'013	3'844'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		15'511'077	2'639'002'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		310'777	2'490'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		38'957'382	41'892'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		57'342'519	67'069'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		9'785'085	81'959'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		235'502	2'842'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.03.2024		665'636	3'102'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		284'746	541'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		6'379'643	5'858'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		2'389	29'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		500'296	4'180'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		626'691	673'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		18'577	29'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		772'192	899'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'927	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		1'725	21'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		19'697	35'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.03.2024		4'960	23'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		91'532	84'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		99'873	16'931'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		10'840	217'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		4'499	36'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		2'103	4'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		14'505	121'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'287	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		12'000	13'115	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		3'851	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		21'926	3'751'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		1'504	30'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		27'619	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		2'253	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		65'000	60'672	EUR/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'947	3'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		605'949	694'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.03.2024		3'047	14'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		49'665	410'000	CHF/CNY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		1'517	12'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		493'961	524'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		91'576	83'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		7'975	14'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		11'678	18'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		218'694	37'285'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		5'094	100'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		4'570	7'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.03.2024		2'166	42'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		31'884	5'414'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		137'627	145'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		68'851	62'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		338'853	383'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		132'387	1'080'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		3'445	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		13'000	12'307	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		1'000	1'107	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.03.2024		39'000	4'753	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		25'494	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		848'000	4'979	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		18'000	17'134	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.03.2024		38'000	4'642	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		1'183'000	6'955	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		2'000	2'226	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		30'765	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		6'600	54'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		24'777	26'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		65'000	57'235	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		3'349	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		9'864	1'685'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		160'176	27'397'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		410'070	430'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		310'225	353'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		21'179	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		5'178	9'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.03.2024		34'260	281'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		63'063	97'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.03.2024		4'001'000	2'597'609	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		69'429'000	61'138'483	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		2'729'434'000	16'058'898	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.03.2024		545'000	292'393	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		6'094'000	6'788'168	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.03.2024		2'488'000	206'728	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		2'538'000	324'458	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.03.2024		837'000	548'160	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.03.2024		88'008'000	10'754'578	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		43'594'000	41'542'902	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		1'588'000	391'519	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		2'871'000	244'351	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.03.2024		3'055'000	1'751'737	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.03.2024		21'335'000	1'100'839	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.03.2024		3'139'000	693'141	PLN/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		367'901	1'564'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		3'992	17'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		1'666	7'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		2'530'753	3'909'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		57'848'222	65'907'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		15'893'915	2'697'482'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.04.2024		288'775	540'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		6'409'737	5'772'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		532'706	815'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		10'992'926	90'103'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		39'885'569	41'940'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		387'387	1'575'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		238'336	2'806'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		1'710'474	2'990'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		1'081'143	21'124'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		683'147	3'105'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		46'202	377'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		14'978	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		69'224	62'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		1'733	7'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		16'648	2'820'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		1'127'585	1'278'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		2'213	10'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		7'022	136'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		1'456	17'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		441'212	461'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		9'272	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		3'285	5'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		7'851	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		91'719	15'439'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		68'044	558'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		104'559	109'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		44'615	862'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		2'603	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		67'515	77'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		1'742	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		14'896	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		2'244	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		5'854	978'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		3'911	32'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		42'996	178'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		14'375	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.04.2024		27'024	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		1'182'000	7'009		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		29'994	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		39'000	4'781		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		18'000	17'302		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		2'000	2'248		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		20'000	17'701		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		69'398	72'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.04.2024		36'000	1'894		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		3'287'000	19'549		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		7'000	7'889		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		110'000	13'526		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		6'000	3'922		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		6'394	11'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		133'000	87'294		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		51'622	58'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		1'987	3'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		133'000	128'558		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		62'763	10'675'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		4'553	86'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		44'066	357'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		1'461	6'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		24'889	22'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		2'684	12'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		114'860	174'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		19'226	17'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		2'025	9'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		440'656	491'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		437'887	451'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		146'464	24'672'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		32'719	265'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		4'682	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		3'429	64'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		46'000	5'699		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		37'694	42'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		2'000	2'270		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		22'000	21'407		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		1'420'000	8'427		JPY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.04.2024		3'084	57'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		1'341	2'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.04.2024		123'523	992'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		338'137	346'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.04.2024		1'813	8'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		50'906	8'545'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		359'064	398'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		4'129	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		100'271	88'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		6'648	10'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.04.2024		2'754'722'000	16'395'003		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.04.2024		1'766'000	434'189		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.04.2024		5'959'000	6'780'508		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.04.2024		92'489'000	11'473'260		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.04.2024		3'981'000	2'649'833		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		43'221'000	42'045'389		EUR/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/PLN Verfall 03.04.2024		3'144'000	710'160		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		68'282'000	61'505'012		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.04.2024		825'000	550'564		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.04.2024		22'293'000	1'208'073		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.04.2024		590'000	317'851		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.04.2024		3'035'000	1'783'336		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.04.2024		2'823'000	237'781		SEK/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		202'629	2'445'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		316'483	2'480'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		2'825	22'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2024		2'502'000	326'243		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.04.2024		2'445'000	202'992		NOK/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		6'587'701	5'808'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		2'597'655	3'914'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		40'948'979	42'184'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		60'113'328	66'962'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		331'637	2'548'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		552'788	830'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 03.05.2024		1'130'118	21'024'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 03.05.2024		323'237	602'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		1'794'107	3'061'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 03.05.2024		166'951	2'016'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		239'870	2'854'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 03.05.2024		47'022	874'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		4'688	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		1'332	2'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		15'878	14'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		5'972	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		1'016'622	1'132'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		176'697	182'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		15'930'388	2'673'005'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 07.05.2024		430'359	1'755'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024		11'695'725	94'543'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 07.05.2024		704'768	3'133'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 07.05.2024		1'575	7'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 07.05.2024		39'439	6'614'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 07.05.2024		30'812	249'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'536'459.79	1.87
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	265'556'892.05	89.65
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	22'948'091.73	7.75
Sonstige Vermögenswerte	2'189'922.92	0.74
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	296'231'366.49	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-787'434.79	
Andere Verbindlichkeiten	-6'474.67	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	295'437'457.03	

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);	288'504'983.78	97.39
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = USD	0.65240000
CAD	1 = USD	0.73896176
CHF	1 = USD	1.11024759
CNY	1 = USD	0.13773346
DKK	1 = USD	0.14479114
EUR	1 = USD	1.07999525
GBP	1 = USD	1.26325000
ILS	1 = USD	0.27294811
JPY	1 = USD	0.00660742
MXN	1 = USD	0.06016214
MYR	1 = USD	0.21128248
NOK	1 = USD	0.09217779
NZD	1 = USD	0.59815000
PLN	1 = USD	0.25076798
SEK	1 = USD	0.09352262
SGD	1 = USD	0.74096028

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	160'861'162.42	54.448
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	93'154'384.16	31.531

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DA USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.008
FA USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.008
GT USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.008
NT USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.008
NTH1 CHF	USD	0.00 - 0.12	-	0.107	0.00 - 0.01	-	0.008

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DA USD	0.180	0.400	0.130	0.050	4.000
FA USD	0.180	0.500	0.130	0.050	4.000
GT USD	0.140	0.350	0.090	0.050	4.000
NT USD	-	-	-	-	4.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	4.000

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

8 Benchmark

FTSE non-CHF World Government Bond Index

9 TER

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

10 Fussnoten

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert 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 0.0001 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 Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes

unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen, getätigt wurden.