

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

Jahresbericht per 30.09.2023

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.

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II), bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigefügte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen, dem Fondsvertrag sowie dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt.

Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in der Jahresrechnung aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes KAG

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	43
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	43
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	44
7	Pauschale Verwaltungskommission	44
8	Benchmark	44
9	TER	44
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	45
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	45
12	Fussnoten	45
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	46

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 (ab 03.01.2023)
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	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
Konsolidiert					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		252'294'531.63	221'849'609.05	238'263'696.21	171'259'864.32
Klasse DA USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'507'203.96	19'652'885.58	24'621'243.63	29'617'099.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		352'144.091	292'006.757	279'949.563	319'589.566
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		66.7545	67.3028	87.9489	92.6723
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		61.0670	66.2428	82.0431	85.1427
Ausschüttung je Anteil		1.35	1.25	1.40	1.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse FA USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		582'050.26	200'977.66	289'399.29	346'767.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'718.358	2'990.000	3'287.000	3'745.442
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		66.7615	67.2166	88.0436	92.5839
Ausschüttung je Anteil		1.35	1.15	1.60	1.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.19 %	0.20 %
Klasse GT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'941'568.84	21'226'238.64	24'807'293.22	24'036'948.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		306'470.251	261'812.251	236'668.636	220'168.634
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		81.3833	81.0743	104.8187	109.1752
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		74.4495	79.7974	97.7801	100.3047
Thesaurierung je Anteil		1.63	1.45	1.76	1.88
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		81'608'919.94	85'803'555.54	136'166'152.20	92'225'504.85
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'030'628.695	1'088'673.520	1'337'494.253	870'556.627
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		79.1836	78.8148	101.8069	105.9385
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		72.4372	77.5734	94.9706	97.3310
Thesaurierung je Anteil		1.70	1.54	1.86	1.96
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF 14)					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		121'654'788.63	94'965'951.63	52'379'607.87	25'033'544.35
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'406'068.638	1'127'026.911	502'664.485	227'591.107
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		79.1496	82.9352	97.2066	101.0565
Thesaurierung je Anteil (in USD)		1.85	1.61	1.92	2.01
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DA USD	0.92 %	-18.31 %	-7.10 %	9.95 %
Klasse FA USD	0.92 %	-18.31 %	-7.10 %	9.93 %
Klasse GT USD	0.97 %	-18.28 %	-7.06 %	10.00 %
Klasse NT USD	1.11 %	-18.17 %	-6.93 %	10.16 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 28.02.2020)	-3.97 %	-15.16 %	-3.36 %	1.02 %
Benchmark Hedge	-3.91 %	-15.21 %	-	-
Benchmark	1.04 %	-18.26 %	-6.97 %	10.11 %
Tracking Error 33)	0.06 %	0.08 %	1.30 %	0.05 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse DA USD	-0.12 %
Klasse FA USD	-0.12 %
Klasse GT USD	-0.07 %
Klasse NT USD	0.07 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 28.02.2020)	-0.06 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	924'979.87	2'111'440.06
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	234'146'395.75	213'001'961.22
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	15'455'531.96	5'565'320.64
Sonstige Vermögenswerte	1'776'769.73	1'235'824.55
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	252'303'677.31	221'914'546.47
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-59'437.53
Andere Verbindlichkeiten	-9'145.68	-5'499.89
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	252'294'531.63	221'849'609.05

Entwicklung der Anzahl Anteile

			<i>Lancierung</i>
	von	01.10.2022	01.10.2021
	bis	30.09.2023	30.09.2022
Klasse DA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		292'006.757	279'949.563
Ausgegebene Anteile		90'807.977	33'439.977
Zurückgenommene Anteile		-30'670.643	-21'382.783
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		352'144.091	292'006.757
Klasse FA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'990.000	3'287.000
Ausgegebene Anteile		5'743.358	1'453.000
Zurückgenommene Anteile		-15.000	-1'750.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'718.358	2'990.000
Klasse GT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		261'812.251	236'668.636
Ausgegebene Anteile		44'658.000	28'708.000
Zurückgenommene Anteile		-	-3'564.385
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		306'470.251	261'812.251
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'088'673.520	1'337'494.253
Ausgegebene Anteile		86'547.101	111'827.205
Zurückgenommene Anteile		-144'591.926	-360'647.938
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'030'628.695	1'088'673.520
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'127'026.911	502'664.485
Ausgegebene Anteile		640'456.932	645'878.795
Zurückgenommene Anteile		-361'415.205	-21'516.369
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'406'068.638	1'127'026.911

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von	01.10.2022	01.10.2021
	bis	30.09.2023	30.09.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		221'849'609.05	238'263'696.21
Ausbezahlte Ausschüttung		-443'450.08	-406'117.35
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'318'980.00	-1'698'314.58
Saldo aus dem Anteilverkehr		30'686'126.40	46'146'499.97
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'521'226.26	-60'456'155.20
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		252'294'531.63	221'849'609.05

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		23'126.74	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-932.00	-3'346.58
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'827'140.10	4'165'316.50
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		353'735.32	41'007.54
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		929'919.49	551'311.46
Total Ertrag		6'132'989.65	4'754'288.92
Aufwand			
Passivzinsen		-2'839.09	-48.30
Reglementarische Vergütungen		-76'380.81	-74'413.46
Sonstige Aufwendungen		-116.22	-19.35
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-700'913.16	-447'770.38
Total Aufwand		-780'249.28	-522'251.49
Nettoertrag / Verlust		5'352'740.37	4'232'037.43
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-8'790'030.63	-1'902'340.47
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		94'480.93	90'684.90
Realisierter Erfolg		-3'342'809.33	2'420'381.86
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		4'864'035.59	-62'876'537.06
Gesamterfolg		1'521'226.26	-60'456'155.20

Verwendung des Erfolges

Klasse DA USD	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	466'889.59	345'478.49
Vortrag des Vorjahres	9'628.42	29'158.38
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	476'518.01	374'636.87
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	475'394.52	365'008.45
Vortrag auf neue Rechnung	1'123.49	9'628.42
Total	476'518.01	374'636.87
Klasse FA USD	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	11'687.81	3'521.97
Vortrag des Vorjahres	94.22	10.75
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	11'782.03	3'532.72
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	11'769.78	3'438.50
Vortrag auf neue Rechnung	12.25	94.22
Total	11'782.03	3'532.72
Klasse GT USD	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	501'977.66	380'463.48
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	501'977.66	380'463.48
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	175'692.18	133'162.22
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	326'285.48	247'301.26
Total	501'977.66	380'463.48
Klasse NT USD	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	1'759'877.73	1'677'886.33
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'759'877.73	1'677'886.33
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	615'957.21	587'260.22
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'143'920.52	1'090'626.11
Total	1'759'877.73	1'677'886.33
Klasse NTH1 CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	2'612'307.58	1'824'687.16
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'612'307.58	1'824'687.16
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	914'307.65	638'640.51
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'697'999.93	1'186'046.65
Total	2'612'307.58	1'824'687.16

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							234'146'395.75	92.80	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							234'146'395.75	92.80	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	130	0	0	130 EUR	110.51%	152'107.34	0.06	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	140	40	0	180 EUR	105.11%	200'307.67	0.08	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	150	0	50	100 EUR	103.45%	109'527.69	0.04	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	45	0	0	45 EUR	102.22%	48'701.44	0.02	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	100	0	0	100 EUR	92.64%	98'082.60	0.04	a)
AT0000A105W3	1.7500 % RAGB 1 3/4 10/20/23	145	0	145	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	95	0	0	95 EUR	90.54%	91'066.27	0.04	a)
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	80	0	0	80 EUR	97.94%	82'955.18	0.03	a)
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	120	50	0	170 EUR	95.84%	172'500.03	0.07	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	100	50	0	150 EUR	92.95%	147'622.58	0.06	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	150	0	40	110 EUR	65.92%	76'769.75	0.03	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	55	0	0	55 EUR	49.03%	28'550.78	0.01	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	50	128	0	178 EUR	91.09%	171'665.94	0.07	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	52	15	0	67 EUR	61.24%	43'441.36	0.02	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	110	0	0	110 EUR	89.97%	104'781.32	0.04	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	130	0	0	130 EUR	86.65%	119'262.90	0.05	a)
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	100	68	0	168 EUR	81.31%	144'626.10	0.06	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	75	25	0	100 EUR	50.56%	53'530.40	0.02	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	42	0	0	42 EUR	33.35%	14'829.91	0.01	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	40	0	0	40 EUR	54.16%	22'936.76	0.01	a)
AT0000A2NWX3	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	110	80	0	190 EUR	78.46%	157'832.10	0.06	a)
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	0	35	0	35 EUR	36.62%	13'570.00	0.01	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	100	0	0	100 EUR	94.74%	100'305.98	0.04	a)
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	50	50	0	100 EUR	65.43%	69'274.02	0.03	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	40	100	45	95 EUR	85.11%	85'604.71	0.03	a)
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	100	0	0	100 EUR	82.13%	86'955.14	0.03	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	0	70	30	40 EUR	70.31%	29'776.29	0.01	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	0	50	0	50 EUR	96.75%	51'217.03	0.02	a)
AT0000A32458	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	0	158	50	108 EUR	95.73%	109'462.47	0.04	a)
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	45	0	45 EUR	98.35%	46'857.63	0.02	a)
AT							2'634'121.39	1.04	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	200	150	150	200 AUD	89.78%	115'885.44	0.05	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	175	0	0	175 AUD	75.95%	85'786.25	0.03	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	283	0	0	283 AUD	81.28%	148'449.15	0.06	a)
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	180	110	0	290 AUD	77.26%	144'606.32	0.06	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	255	0	150	105 AUD	95.65%	64'817.78	0.03	a)
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	261	0	0	261 AUD	79.49%	133'897.06	0.05	a)
AU0000095457	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/25 161	130	115	0	245 AUD	92.23%	145'832.10	0.06	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	152	70	0	222 AUD	52.89%	75'775.86	0.03	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	385	0	0	385 AUD	76.83%	190'898.96	0.08	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	215	100	0	315 AUD	90.06%	183'086.78	0.07	a)
AU0000143901	1.7500 % ACGB 1 3/4 11/21/32 165	200	110	0	310 AUD	79.76%	159'575.02	0.06	a)
AU0000217101	3.0000 % ACGB 3 11/21/33 166	70	180	0	250 AUD	87.92%	141'858.92	0.06	a)
AU0000249302	3.7500 % ACGB 3 3/4 05/21/34 167	0	150	0	150 AUD	93.62%	90'628.68	0.04	a)
AU0000274706	3.5000 % ACGB 3 1/2 12/21/34 168	0	250	75	175 AUD	91.02%	102'801.41	0.04	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	200	150	100	250 AUD	100.21%	161'680.77	0.06	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	213	0	0	213 AUD	100.38%	137'987.09	0.05	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	113	0	0	113 AUD	83.75%	61'081.23	0.02	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	100	0	0	100 AUD	83.73%	54'038.70	0.02	a)
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	160	60	0	220 AUD	94.88%	134'716.79	0.05	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	139	100	75	164 AUD	92.12%	97'506.03	0.04	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	144	25	0	169 AUD	74.12%	80'842.43	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
AU000XCLWAU3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	135	0	0	135 AUD	93.56%	81'520.51	0.03	a)
AU000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	170	0	0	170 AUD	92.01%	100'953.73	0.04	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	240	0	0	240 AUD	102.15%	158'221.62	0.06	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	166	0	166	0 AUD	0.00%	0.00	0.00	
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	155	90	0	245 AUD	95.36%	150'787.67	0.06	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	232	0	0	232 AUD	98.60%	147'641.03	0.06	a)
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	170	0	0	170 AUD	91.18%	100'037.58	0.04	a)
AU							3'250'914.91	1.29	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	280	0	40	240 EUR	109.85%	279'116.16	0.11	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	203	100	0	303 EUR	113.00%	362'515.05	0.14	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	200	0	0	200 EUR	105.30%	222'972.76	0.09	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	0	90	0	90 EUR	102.88%	98'031.78	0.04	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	100	0	0	100 EUR	104.68%	110'829.95	0.04	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	120	50	70	100 EUR	97.90%	103'651.63	0.04	a)
BE0000332412	2.6000 % BGB 2.6 06/22/24 72	191	0	191	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	100	0	0	100 EUR	95.24%	100'835.35	0.04	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	310	0	65	245 EUR	95.70%	248'239.83	0.10	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	180	0	0	180 EUR	84.43%	160'902.48	0.06	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	110	0	0	110 EUR	79.34%	92'401.35	0.04	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	200	0	0	200 EUR	94.34%	199'764.96	0.08	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	125	0	0	125 EUR	64.80%	85'758.75	0.03	a)
BE0000339482	0.2000 % BGB 0.2 10/22/23 79	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	50	60	0	110 EUR	65.36%	76'119.89	0.03	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	100	100	0	200 EUR	91.88%	194'555.91	0.08	a)
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	121	0	121	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	69	0	0	69 EUR	69.24%	50'582.42	0.02	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	40	0	0	40 EUR	76.01%	32'190.24	0.01	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	0	230	50	180 EUR	89.98%	171'477.49	0.07	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	190	0	75	115 EUR	82.88%	100'911.58	0.04	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	140	110	50	200 EUR	88.39%	187'165.83	0.07	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	120	0	0	120 EUR	63.53%	80'718.68	0.03	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	100	100	50	150 EUR	81.36%	129'209.85	0.05	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	102	0	0	102 EUR	58.11%	62'754.44	0.02	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	150	0	0	150 EUR	88.21%	140'088.51	0.06	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	150	0	0	150 EUR	76.74%	121'872.72	0.05	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	70	0	0	70 EUR	34.05%	25'235.31	0.01	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	0	160	0	160 EUR	77.27%	130'895.38	0.05	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	70	100	50	120 EUR	56.20%	71'402.10	0.03	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	0	58	0	58 EUR	87.97%	54'020.18	0.02	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	0	110	0	110 EUR	96.07%	111'885.53	0.04	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	0	70	0	70 EUR	87.95%	65'181.95	0.03	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	0	40	0	40 EUR	93.75%	39'703.13	0.02	a)
BE							3'910'991.19	1.55	
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	230	0	230	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	50	20	0	70 CAD	77.70%	40'228.25	0.02	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	120	0	0	120 CAD	82.09%	72'857.40	0.03	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	0	0	100 CAD	95.89%	70'921.60	0.03	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	135	0	50	85 CAD	92.48%	58'143.90	0.02	a)
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	100	0	0	100 CAD	88.90%	65'755.18	0.03	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	100	0	0	100 CAD	90.90%	67'235.95	0.03	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	477	0	75	402 CAD	68.47%	203'577.91	0.08	a)
CA135087H987	2.0000 % CAN 2 09/01/23	170	0	170	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	88	0	0	88 CAD	90.86%	59'140.30	0.02	a)
CA135087J546	2.2500 % CAN 2 1/4 03/01/24	199	0	199	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087J967	1.5000 % CAN 1 1/2 09/01/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	346	100	100	346 CAD	83.56%	213'849.50	0.08	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	100	0	0	100 CAD	95.00%	70'264.05	0.03	a)
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	280	0	0	280 CAD	92.17%	190'876.33	0.08	a)
CA135087L443	0.5000 % CAN 0 1/2 12/01/30	300	35	0	335 CAD	77.91%	193'033.84	0.08	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	180	0	0	180 CAD	90.10%	119'954.29	0.05	a)
CA135087L690	0.2500 % CAN 0 1/4 04/01/24	200	0	200	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
CA135087L930	1.0000 % CAN 1 09/01/26	180	0	0	180 CAD	90.51%	120'498.82	0.05	a)
CA135087M276	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/31	392	0	0	392 CAD	83.10%	240'926.33	0.10	a)
CA135087M508	0.7500 % CAN 0 3/4 10/01/24	100	0	0	100 CAD	95.86%	70'901.63	0.03	a)
CA135087M680	1.7500 % CAN 1 3/4 12/01/53	190	165	0	355 CAD	63.15%	165'804.96	0.07	a)
CA135087M763	0.5000 % CAN 0 1/2 11/01/23	70	0	70	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087M847	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/27	95	80	0	175 CAD	89.94%	116'416.42	0.05	a)
CA135087M920	0.7500 % CAN 0 3/4 02/01/24	100	0	100	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087N266	1.5000 % CAN 1 1/2 12/01/31	300	70	0	370 CAD	82.29%	225'199.19	0.09	a)
CA135087N340	1.5000 % CAN 1 1/2 04/01/25	150	0	0	150 CAD	94.99%	105'392.75	0.04	a)
CA135087N597	2.0000 % CAN 2 06/01/32	0	290	0	290 CAD	85.01%	182'352.51	0.07	a)
CA135087N670	2.2500 % CAN 2 1/4 12/01/29	0	50	0	50 CAD	90.24%	33'374.37	0.01	a)
CA135087N837	2.7500 % CAN 2 3/4 09/01/27	100	110	0	210 CAD	94.16%	146'257.54	0.06	a)
CA135087N910	2.7500 % CAN 2 3/4 08/01/24	150	0	150	0 CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA135087P246	3.0000 % CAN 3 10/01/25	50	80	0	130 CAD	96.57%	92'850.96	0.04	a)
CA135087P329	2.5000 % CAN 2 1/2 12/01/32	0	80	0	80 CAD	88.22%	52'199.41	0.02	a)
CA135087P402	3.0000 % CAN 3 11/01/24	0	180	0	180 CAD	97.75%	130'143.20	0.05	a)
CA135087P576	3.5000 % CAN 3 1/2 03/01/28	0	160	0	160 CAD	97.01%	114'800.00	0.05	a)
CA135087P659	3.7500 % CAN 3 3/4 02/01/25	0	150	0	150 CAD	98.31%	109'076.18	0.04	a)
CA135087P816	3.0000 % CAN 3 04/01/26	0	150	0	150 CAD	96.17%	106'697.49	0.04	a)
CA135087P998	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/55	0	90	0	90 CAD	79.93%	53'209.84	0.02	a)
CA135087Q236	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/33	0	150	0	150 CAD	89.82%	99'656.80	0.04	a)
CA135087Q319	3.7500 % CAN 3 3/4 05/01/25	0	240	75	165 CAD	98.19%	119'837.35	0.05	a)
CA135087Q491	3.2500 % CAN 3 1/4 09/01/28	0	155	0	155 CAD	95.60%	109'604.03	0.04	a)
CA135087Q640	3.5000 % CAN 3 1/2 08/01/25	0	250	0	250 CAD	97.62%	180'510.35	0.07	a)
CA135087Q723	3.2500 % CAN 3 1/4 12/01/33	0	50	0	50 CAD	93.46%	34'562.13	0.01	a)
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	90	0	0	90 CAD	108.19%	72'018.64	0.03	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	320	0	150	170 CAD	113.37%	142'547.26	0.06	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	50	0	0	50 CAD	109.98%	40'674.56	0.02	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	70	50	50	70 CAD	100.07%	51'811.91	0.02	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	87	40	0	127 CAD	93.62%	87'939.05	0.03	a)
CA							4'431'102.18	1.76	
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	70	100	0	170 EUR	83.30%	149'936.79	0.06	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	47	0	0	47 EUR	93.96%	46'753.68	0.02	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	80	40	0	120 EUR	45.96%	58'385.83	0.02	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	150	0	55	95 EUR	80.90%	81'367.22	0.03	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	0	150	50	100 EUR	94.45%	99'993.65	0.04	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	0	100	55	45 EUR	76.27%	36'337.41	0.01	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	265	0	265	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	301	122	60	363 EUR	91.60%	352'035.17	0.14	a)
DE0001102358	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/24	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	211	55	266	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	250	150	100	300 EUR	96.18%	305'494.91	0.12	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	250	104	0	354 EUR	96.06%	360'011.75	0.14	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	300	112	100	312 EUR	94.26%	311'365.77	0.12	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	291	130	70	351 EUR	92.06%	342'107.10	0.14	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	365	0	0	365 EUR	91.76%	354'585.34	0.14	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	350	0	0	350 EUR	91.72%	339'861.41	0.13	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	360	103	85	378 EUR	69.95%	279'941.15	0.11	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	240	60	0	300 EUR	90.85%	288'565.50	0.11	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	250	80	0	330 EUR	88.83%	310'371.41	0.12	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	235	137	55	317 EUR	87.81%	294'721.29	0.12	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	200	200	80	320 EUR	85.46%	289'538.49	0.11	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	296	155	0	451 EUR	45.74%	218'392.47	0.09	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	150	190	0	340 EUR	84.35%	303'649.72	0.12	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	365	0	0	365 EUR	83.23%	321'633.28	0.13	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	311	0	50	261 EUR	71.62%	197'915.77	0.08	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	190	45	0	235 EUR	89.32%	222'238.73	0.09	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	260	35	0	295 EUR	82.04%	256'227.20	0.10	a)
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	160	185	65	280 EUR	69.36%	205'614.76	0.08	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	200	170	80	290 EUR	87.12%	267'494.15	0.11	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	250	145	50	345 EUR	80.86%	295'338.06	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	160	105	0	265 EUR	43.05%	120'782.05	0.05	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	210	140	0	350 EUR	79.66%	295'204.92	0.12	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	60	120	0	180 EUR	76.58%	145'949.96	0.06	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	70	235	0	305 EUR	91.65%	295'945.36	0.12	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	0	220	0	220 EUR	76.12%	177'307.18	0.07	a)
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	0	205	0	205 EUR	96.36%	209'149.88	0.08	a)
DE0001104859	0.0000 % BKO 0 09/15/23	160	0	160	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104867	0.0000 % BKO 0 12/15/23	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104875	0.0000 % BKO 0 03/15/24	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	170	0	170	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104891	0.4000 % BKO 0.4 09/13/24	0	180	180	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104909	2.2000 % BKO 2.2 12/12/24	0	210	80	130 EUR	98.52%	135'596.34	0.05	a)
DE0001134922	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/24	150	0	150	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	129	50	0	179 EUR	112.55%	213'298.65	0.08	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	181	0	0	181 EUR	111.22%	213'129.32	0.08	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	200	0	50	150 EUR	108.74%	172'692.72	0.07	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	275	0	125	150 EUR	119.97%	190'522.60	0.08	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	302	0	70	232 EUR	117.78%	289'300.57	0.11	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	305	0	40	265 EUR	117.14%	328'644.22	0.13	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	335	0	30	305 EUR	111.19%	359'046.91	0.14	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	190	70	50	210 EUR	115.30%	256'346.25	0.10	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	210	47	0	257 EUR	122.47%	333'247.51	0.13	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	193	0	0	193 EUR	102.95%	210'372.88	0.08	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	310	100	80	330 EUR	91.99%	321'387.60	0.13	a)
DE0001141786	0.0000 % OBL 0 10/13/23 178	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141794	0.0000 % OBL 0 04/05/24 179	290	0	290	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141802	0.0000 % OBL 0 10/18/24 180	211	55	266	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	280	0	0	280 EUR	95.13%	282'006.97	0.11	a)
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	253	120	75	298 EUR	93.91%	296'302.57	0.12	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	230	90	0	320 EUR	92.79%	314'372.53	0.12	a)
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	270	0	0	270 EUR	91.67%	262'061.60	0.10	a)
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	175	89	0	264 EUR	90.56%	253'129.86	0.10	a)
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	80	277	50	307 EUR	94.37%	306'736.72	0.12	a)
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	0	228	0	228 EUR	98.74%	238'353.43	0.09	a)
DE000BU22015	2.8000 % BKO 2.8 06/12/25	0	225	0	225 EUR	99.17%	236'248.69	0.09	a)
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	0	80	0	80 EUR	99.79%	84'524.67	0.03	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	0	300	0	300 EUR	97.56%	309'878.14	0.12	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	0	100	0	100 EUR	98.27%	104'043.37	0.04	a)
DE000BU2Z007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	0	446	35	411 EUR	95.91%	417'340.08	0.17	a)
DE000BU2Z015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33 10Y	0	60	0	60 EUR	98.04%	62'279.28	0.02	a)
DE000BU3Z005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	0	75	0	75 EUR	95.97%	76'204.59	0.03	a)
DE							14'101'285.43	5.59	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	1'050	180	0	1'230 DKK	116.14%	202'822.87	0.08	a)
DK0009923054	1.5000 % DGB 1 1/2 11/15/23	700	0	700	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	550	0	0	550 DKK	97.06%	75'793.67	0.03	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	650	0	0	650 DKK	90.61%	83'621.79	0.03	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	1'000	0	0	1'000 DKK	86.47%	122'770.90	0.05	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	700	0	0	700 DKK	45.46%	45'182.16	0.02	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	500	0	0	500 DKK	78.76%	55'911.38	0.02	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	250	400	0	650 DKK	96.23%	88'809.28	0.04	a)
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	0	500	0	500 DKK	92.37%	65'573.89	0.03	a)
DK							740'485.94	0.29	
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	530	0	100	430 EUR	111.80%	508'974.39	0.20	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	219	0	0	219 EUR	106.91%	247'878.94	0.10	a)
ES00000121G2	4.8000 % SPGB 4.8 01/31/24	180	0	180	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	230	0	0	230 EUR	104.58%	254'653.21	0.10	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	380	0	150	230 EUR	101.90%	248'129.51	0.10	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	360	0	100	260 EUR	106.28%	292'565.03	0.12	a)
ES00000123X3	4.4000 % SPGB 4.4 10/31/23	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	300	0	50	250 EUR	114.62%	303'371.59	0.12	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	50	0	0	50 EUR	107.44%	56'874.46	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	145	30	0	175 EUR	110.58%	204'878.46	0.08	a)
ES00000124W3	3.8000 % SPGB 3.8 04/30/24	270	0	270	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	227	0	177	50 EUR	98.87%	52'340.37	0.02	a)
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	130	70	0	200 EUR	96.97%	205'338.22	0.08	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	257	0	0	257 EUR	89.99%	244'858.95	0.10	a)
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	200	100	0	300 EUR	97.33%	309'141.25	0.12	a)
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	150	80	0	230 EUR	96.26%	234'397.84	0.09	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	200	60	50	210 EUR	78.48%	174'494.92	0.07	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	148	30	0	178 EUR	79.09%	149'049.16	0.06	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	235	0	0	235 EUR	93.76%	233'285.72	0.09	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	315	0	0	315 EUR	93.46%	311'678.28	0.12	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	180	50	0	230 EUR	87.63%	213'382.71	0.08	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	270	50	150	170 EUR	100.81%	181'452.61	0.07	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	209	60	0	269 EUR	92.39%	263'118.80	0.10	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	200	156	100	256 EUR	91.30%	247'462.24	0.10	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	200	55	40	215 EUR	74.12%	168'720.29	0.07	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	280	0	0	280 EUR	90.85%	269'330.76	0.11	a)
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	72	200	0	272 EUR	89.56%	257'906.26	0.10	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	280	0	0	280 EUR	79.79%	236'540.43	0.09	a)
ES0000012E85	0.2500 % SPGB 0 1/4 07/30/24 5YR	270	0	270	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	200	45	0	245 EUR	83.99%	217'870.01	0.09	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	280	75	80	275 EUR	82.09%	239'018.91	0.09	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	200	100	0	300 EUR	95.29%	302'655.35	0.12	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	234	50	50	234 EUR	46.69%	115'670.83	0.05	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	263	0	0	263 EUR	90.53%	252'090.28	0.10	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	270	50	50	270 EUR	85.23%	243'637.76	0.10	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	170	100	55	215 EUR	62.70%	142'722.52	0.06	a)
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	208	0	0	208 EUR	92.21%	203'073.68	0.08	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	151	0	151	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	244	0	0	244 EUR	76.61%	197'902.70	0.08	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	50	30	0	80 EUR	40.68%	34'456.81	0.01	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	234	150	100	284 EUR	86.22%	259'253.62	0.10	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	70	123	0	193 EUR	65.49%	133'813.28	0.05	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	250	0	0	250 EUR	77.82%	205'990.41	0.08	a)
ES0000012I07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	50	95	50	95 EUR	57.52%	57'853.33	0.02	a)
ES0000012I15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	0	270	0	270 EUR	89.15%	254'857.86	0.10	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	220	50	0	270 EUR	77.92%	222'752.64	0.09	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	0	274	0	274 EUR	94.28%	273'492.33	0.11	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	100	69	0	169 EUR	58.32%	104'354.83	0.04	a)
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	0	249	0	249 EUR	85.66%	225'829.67	0.09	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	80	221	50	251 EUR	90.43%	240'319.66	0.10	a)
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	0	150	30	120 EUR	87.56%	111'239.90	0.04	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	0	275	70	205 EUR	98.20%	213'128.29	0.08	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	0	300	50	250 EUR	94.30%	249'589.73	0.10	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	0	95	0	95 EUR	95.59%	96'146.63	0.04	a)
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	0	200	0	200 EUR	96.96%	205'317.04	0.08	a)
ES							10'672'862.47	4.23	
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25	110	0	110	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI40000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	50	0	0	50 EUR	98.10%	51'930.63	0.02	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	90	0	0	90 EUR	86.67%	82'580.91	0.03	a)
FI4000079041	2.0000 % RFGB 2 04/15/24	90	0	90	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	140	0	0	140 EUR	83.21%	123'340.99	0.05	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	30	0	0	30 EUR	95.33%	30'279.83	0.01	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	100	0	0	100 EUR	93.45%	98'934.90	0.04	a)
FI4000219787	0.0000 % RFGB 0 09/15/23	60	0	60	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	55	0	0	55 EUR	65.64%	38'220.66	0.02	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	100	0	0	100 EUR	90.13%	95'427.26	0.04	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34	50	0	0	50 EUR	79.68%	42'182.72	0.02	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	30	50	0	80 EUR	87.69%	74'269.20	0.03	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29	84	0	0	84 EUR	85.41%	75'958.50	0.03	a)
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36	50	0	0	50 EUR	65.49%	34'667.18	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	20	0	0	20 EUR	57.65%	12'207.39	0.00	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	25	25	0	50 EUR	39.88%	21'113.06	0.01	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31	0	70	0	70 EUR	77.85%	57'696.58	0.02	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26	0	100	0	100 EUR	90.98%	96'325.08	0.04	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43	0	55	0	55 EUR	56.52%	32'910.56	0.01	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32	0	50	0	50 EUR	85.77%	45'401.85	0.02	a)
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38	0	50	0	50 EUR	89.95%	47'618.87	0.02	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33	0	60	0	60 EUR	96.45%	61'266.69	0.02	a)
FI							1'122'332.86	0.44	
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	407	0	20	387 EUR	118.55%	485'742.34	0.19	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	332	0	0	332 EUR	105.19%	369'748.12	0.15	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	400	0	0	400 EUR	111.62%	472'710.72	0.19	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	283	80	75	288 EUR	111.51%	340'016.30	0.13	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	195	50	50	195 EUR	101.96%	210'502.80	0.08	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	295	70	105	260 EUR	103.87%	285'928.15	0.11	a)
FR0010466938	4.2500 % FRTR 4 1/4 10/25/23	450	0	450	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	377	60	50	387 EUR	109.70%	449'480.68	0.18	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	164	60	0	224 EUR	102.05%	242'021.79	0.10	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	435	87	45	477 EUR	100.63%	508'205.42	0.20	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	627	0	60	567 EUR	98.48%	591'186.54	0.23	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	280	80	50	310 EUR	92.00%	301'955.51	0.12	a)
FR0011619436	2.2500 % FRTR 2 1/4 05/25/24	440	0	440	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	579	170	100	649 EUR	96.02%	659'781.05	0.26	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	370	0	300	70 EUR	97.95%	72'593.20	0.03	a)
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	400	241	150	491 EUR	95.38%	495'829.37	0.20	a)
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	430	60	60	430 EUR	95.32%	433'956.23	0.17	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	530	190	55	665 EUR	88.55%	623'452.90	0.25	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	495	125	70	550 EUR	93.20%	542'715.27	0.22	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	170	30	10	190 EUR	57.87%	116'412.74	0.05	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	418	130	0	548 EUR	76.55%	444'139.29	0.18	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	436	80	40	476 EUR	91.32%	460'220.86	0.18	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	350	125	115	360 EUR	77.57%	295'658.07	0.12	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	425	150	125	450 EUR	92.65%	441'419.36	0.17	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	320	50	50	320 EUR	71.30%	241'564.41	0.10	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	550	162	0	712 EUR	89.78%	676'788.60	0.27	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	420	80	0	500 EUR	80.52%	426'252.77	0.17	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	520	310	190	640 EUR	88.82%	601'844.34	0.24	a)
FR0013344751	0.0000 % FRTR 0 03/25/24	414	0	414	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	370	50	30	390 EUR	61.60%	254'354.11	0.10	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	535	128	0	663 EUR	86.47%	606'977.27	0.24	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	580	0	40	540 EUR	95.07%	543'538.98	0.22	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	500	50	50	500 EUR	82.59%	437'210.83	0.17	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	304	115	100	319 EUR	47.15%	159'245.01	0.06	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	457	150	115	492 EUR	92.60%	482'358.05	0.19	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	250	40	0	290 EUR	60.42%	185'512.06	0.07	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	525	182	90	617 EUR	79.81%	521'357.85	0.21	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	308	0	308	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072	66	70	0	136 EUR	30.98%	44'608.10	0.02	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	210	60	40	230 EUR	53.49%	130'254.84	0.05	a)
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	535	190	150	575 EUR	76.99%	468'700.70	0.19	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	350	124	0	474 EUR	89.92%	451'261.29	0.18	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	245	110	0	355 EUR	45.93%	172'630.78	0.07	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32	300	200	75	425 EUR	75.53%	339'861.41	0.13	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	150	250	0	400 EUR	95.31%	403'637.87	0.16	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	0	150	0	150 EUR	72.75%	115'536.10	0.05	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	100	551	150	501 EUR	90.28%	478'875.61	0.19	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	0	560	0	560 EUR	89.58%	531'119.84	0.21	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	0	150	0	150 EUR	82.08%	130'353.30	0.05	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	185	0	185 EUR	84.00%	164'529.76	0.07	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	390	75	315 EUR	97.94%	326'636.03	0.13	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	0	285	0	285 EUR	96.87%	292'299.18	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29	0	120	0	120 EUR	97.92%	124'407.36	0.05	a)
FR							18'155'393.16	7.20	
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	85	60	0	145 GBP	107.69%	190'589.49	0.08	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	160	140	80	220 GBP	99.52%	267'232.10	0.11	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	230	0	0	230 GBP	100.26%	281'456.39	0.11	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	145	40	0	185 GBP	96.98%	218'982.54	0.09	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	155	50	40	165 GBP	100.58%	202'558.82	0.08	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	205	0	0	205 GBP	90.53%	226'517.60	0.09	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	151	30	0	181 GBP	91.16%	201'390.26	0.08	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	150	0	0	150 GBP	99.49%	182'148.78	0.07	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	191	50	50	191 GBP	96.06%	223'939.92	0.09	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	260	0	50	210 GBP	102.83%	263'569.23	0.10	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	110	95	70	135 GBP	90.71%	149'466.72	0.06	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	137	0	0	137 GBP	94.44%	157'918.18	0.06	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	110	50	0	160 GBP	100.03%	195'346.59	0.08	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	170	0	50	120 GBP	86.69%	126'971.38	0.05	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	145	75	60	160 GBP	93.72%	183'023.91	0.07	a)
GB00B6RNHS72	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	115	100	60	155 GBP	82.81%	156'664.31	0.06	a)
GB00B7Z53659	2.2500 % UKT 2 1/4 09/07/23	100	0	100	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	210	0	0	210 GBP	79.22%	203'053.14	0.08	a)
GB00BJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	164	0	0	164 GBP	77.71%	155'552.26	0.06	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	90	120	0	210 GBP	49.76%	127'542.59	0.05	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	175	64	0	239 GBP	52.85%	154'169.50	0.06	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	180	0	0	180 GBP	89.26%	196'103.33	0.08	a)
GB00BFMCM652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	130	25	0	155 GBP	43.30%	81'917.21	0.03	a)
GB00BFVWFL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	160	0	160	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BFVWPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	109	0	0	109 GBP	55.07%	73'265.10	0.03	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	180	0	0	180 GBP	88.13%	193'620.73	0.08	a)
GB00BFHBFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	140	0	140	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BJLROJ16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	50	90	0	140 GBP	48.88%	83'524.68	0.03	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	155	0	0	155 GBP	82.16%	155'434.60	0.06	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	232	100	60	272 GBP	57.60%	191'226.01	0.08	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	130	60	0	190 GBP	93.59%	217'039.42	0.09	a)
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	150	50	0	200 GBP	76.37%	186'426.81	0.07	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	118	60	0	178 GBP	90.58%	196'792.21	0.08	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	0	360	0	360 GBP	98.56%	433'070.67	0.17	a)
GB00BLDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	50	85	0	135 GBP	33.65%	55'446.54	0.02	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	90	176	0	266 GBP	45.41%	147'430.97	0.06	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	100	279	225	154 GBP	94.17%	177'006.36	0.07	a)
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	130	197	0	327 GBP	81.81%	326'519.95	0.13	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	135	129	0	264 GBP	60.91%	196'267.37	0.08	a)
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	110	170	50	230 GBP	71.90%	201'842.35	0.08	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	140	280	0	420 GBP	76.72%	393'290.50	0.16	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	90	75	0	165 GBP	47.68%	96'023.11	0.04	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	130	250	50	330 GBP	27.18%	109'476.01	0.04	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	247	0	0	247 GBP	36.92%	111'304.88	0.04	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	140	100	150	90 GBP	83.59%	91'823.20	0.04	a)
GB00BMF9LG83	4.5000 % UKT 4 1/2 06/07/28	0	100	0	100 GBP	100.03%	122'091.62	0.05	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	317	0	317	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	238	100	0	338 GBP	73.21%	302'024.85	0.12	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	195	50	0	245 GBP	64.38%	192'518.57	0.08	a)
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	0	281	0	281 GBP	91.15%	312'621.30	0.12	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	200	62	0	262 GBP	81.74%	261'391.52	0.10	a)
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	180	133	0	313 GBP	88.46%	337'945.64	0.13	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	130	40	0	170 GBP	46.13%	95'716.75	0.04	a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	0	150	0	150 GBP	97.33%	178'194.20	0.07	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	0	213	100	113 GBP	82.33%	113'551.31	0.05	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	0	190	0	190 GBP	89.93%	208'551.72	0.08	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	114	150	50	214 GBP	95.09%	248'372.89	0.10	a)
GB00BYYMZX75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	190	0	0	190 GBP	59.98%	139'091.68	0.06	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	123	100	50	173 GBP	92.39%	195'092.58	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	220	0	0	220 GBP	70.33%	188'850.82	0.07	a)
GB							10'678'961.17	4.23	
IE000GVLBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	0	62	50	12 EUR	91.62%	11'640.32	0.00	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	140	0	50	90 EUR	102.81%	97'965.08	0.04	a)
IE00B6X95T99	3.4000 % IRISH 3.4 03/18/24	40	0	40	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDPR44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	100	0	0	100 EUR	90.56%	95'880.40	0.04	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	50	0	0	50 EUR	83.55%	44'229.28	0.02	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	100	0	0	100 EUR	88.00%	93'170.00	0.04	a)
IE00BH35Q895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	110	0	0	110 EUR	89.53%	104'268.88	0.04	a)
IE00BH35QB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	85	0	0	85 EUR	62.97%	56'669.07	0.02	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	150	0	50	100 EUR	95.55%	101'163.57	0.04	a)
IE00BKFCV345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	65	0	0	65 EUR	71.27%	49'047.12	0.02	a)
IE00BKFCV568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	50	0	0	50 EUR	90.01%	47'649.05	0.02	a)
IE00BKFCV899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	0	100	0	100 EUR	81.41%	86'192.84	0.03	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	0	86	0	86 EUR	77.59%	70'647.64	0.03	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	75	0	0	75 EUR	77.54%	61'571.61	0.02	a)
IE00BMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	90	0	0	90 EUR	60.20%	57'363.08	0.02	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	90	50	0	140 EUR	75.11%	111'331.80	0.04	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	130	0	0	130 EUR	94.63%	130'246.37	0.05	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	40	0	0	40 EUR	79.89%	33'833.42	0.01	a)
IE							1'252'869.53	0.50	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	300	0	0	300 ILS	105.32%	82'990.60	0.03	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	250	0	0	250 ILS	113.71%	74'673.99	0.03	a)
IL0011308488	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/24 0324	280	0	280	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	300	0	0	300 ILS	94.96%	74'827.23	0.03	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	300	0	0	300 ILS	92.60%	72'969.44	0.03	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	230	0	0	230 ILS	89.56%	54'107.94	0.02	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	150	0	0	150 ILS	91.17%	35'920.47	0.01	a)
IL0011550683	1.5000 % ILGOV 1 1/2 11/30/23 1123	300	0	300	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	70	350	0	420 ILS	81.90%	90'359.14	0.04	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	250	0	0	250 ILS	93.87%	61'645.10	0.02	a)
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	200	0	0	200 ILS	71.11%	37'355.84	0.01	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	0	100	0	100 ILS	72.03%	18'921.27	0.01	a)
IL							603'771.02	0.24	
IT0000366655	9.0000 % BTPS 9 11/01/23 30Y	165	0	165	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	150	0	0	150 EUR	109.33%	173'632.89	0.07	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	260	0	0	260 EUR	109.16%	300'479.19	0.12	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	540	0	0	540 EUR	105.41%	602'678.21	0.24	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	340	50	0	390 EUR	110.19%	454'984.17	0.18	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	910	0	400	510 EUR	108.39%	585'249.18	0.23	a)
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	100	220	0	320 EUR	101.81%	344'922.13	0.14	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	311	80	0	391 EUR	91.66%	379'433.64	0.15	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	255	50	75	230 EUR	100.01%	243'524.68	0.10	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	260	0	0	260 EUR	101.33%	278'947.18	0.11	a)
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	220	50	100	170 EUR	99.69%	179'433.15	0.07	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	280	0	0	280 EUR	101.27%	300'214.93	0.12	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	249	0	0	249 EUR	102.71%	270'783.64	0.11	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	249	60	50	179 EUR	95.87%	181'687.34	0.07	a)
IT0004953417	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/24 11Y	250	0	250	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005001547	3.7500 % BTPS 3 3/4 09/01/24 10Y	186	70	256	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	50	270	0	320 EUR	95.52%	323'618.38	0.13	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24 10Y	200	0	0	200 EUR	98.38%	208'328.13	0.08	a)
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	100	100	0	200 EUR	75.92%	160'764.84	0.06	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	200	100	100	200 EUR	96.03%	203'345.65	0.08	a)
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	0	310	0	310 EUR	80.21%	263'269.10	0.10	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	350	0	129	221 EUR	96.09%	224'837.33	0.09	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	250	0	50	200 EUR	68.53%	145'103.81	0.06	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	220	0	0	220 EUR	94.16%	219'331.51	0.09	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	130	50	0	180 EUR	75.22%	143'350.52	0.06	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	200	70	0	270 EUR	92.03%	263'073.55	0.10	a)
IT0005215246	0.6500 % BTPS 0.65 10/15/23 7Y	100	0	100	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	95	20	0	115 EUR	61.49%	74'872.79	0.03	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	0	105	0	105 EUR	82.67%	91'898.76	0.04	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	230	0	0	230 EUR	93.93%	228'733.74	0.09	a)
IT0005246340	1.8500 % BTPS 1.85 05/15/24 7Y	220	0	220	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	200	0	0	200 EUR	77.88%	164'906.67	0.07	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	200	0	0	200 EUR	93.10%	197'141.37	0.08	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24 7Y	230	0	150	80 EUR	97.29%	82'401.25	0.03	a)
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	150	25	0	175 EUR	79.10%	146'559.33	0.06	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	200	85	0	285 EUR	91.91%	277'326.66	0.11	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	144	0	0	144 EUR	96.13%	146'553.71	0.06	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	221	100	0	321 EUR	93.78%	318'733.14	0.13	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	0	230	0	230 EUR	97.17%	236'628.41	0.09	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	170	0	0	170 EUR	87.16%	156'880.71	0.06	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	145	50	100	95 EUR	82.42%	82'899.07	0.03	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	270	0	0	270 EUR	93.61%	267'593.04	0.11	a)
IT0005367492	1.7500 % BTPS 1 3/4 07/01/24 5Y	162	0	162	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	157	100	150	107 EUR	95.19%	107'837.19	0.04	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	125	50	0	175 EUR	78.90%	146'181.35	0.06	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	270	50	0	320 EUR	83.25%	282'051.01	0.11	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	257	0	50	207 EUR	95.38%	209'033.82	0.08	a)
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	155	65	0	220 EUR	90.49%	210'766.85	0.08	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	150	56	0	206 EUR	62.48%	136'274.81	0.05	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	160	0	0	160 EUR	68.66%	116'306.66	0.05	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	190	0	0	190 EUR	79.94%	160'815.34	0.06	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	250	0	0	250 EUR	96.51%	255'455.21	0.10	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	255	0	0	255 EUR	83.12%	224'405.72	0.09	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	320	0	75	245 EUR	88.88%	230'554.36	0.09	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	174	55	0	229 EUR	92.44%	224'133.95	0.09	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	200	0	0	200 EUR	63.12%	133'658.72	0.05	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	285	0	0	285 EUR	77.68%	234'379.47	0.09	a)
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24 4Y	140	0	140	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	190	0	0	190 EUR	51.74%	104'073.43	0.04	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	190	0	0	190 EUR	61.96%	124'630.23	0.05	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	193	50	50	193 EUR	84.53%	172'721.42	0.07	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	230	0	0	230 EUR	74.71%	181'925.76	0.07	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	250	0	0	250 EUR	90.72%	240'113.92	0.10	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	134	25	0	159 EUR	54.53%	91'799.85	0.04	a)
IT0005439275	0.0000 % BTPS 0 04/15/24 3Y	306	0	306	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	50	15	0	65 EUR	50.69%	34'884.91	0.01	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	150	100	100	150 EUR	84.44%	134'104.46	0.05	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	210	0	0	210 EUR	76.03%	169'052.10	0.07	a)
IT0005452989	0.0000 % BTPS 0 08/15/24 3Y	200	0	200	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454050	0.0000 % BTPS 0 01/30/24 3Y	160	0	160	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	140	55	0	195 EUR	89.52%	184'819.64	0.07	a)
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	0	100	0	100 EUR	74.57%	78'952.05	0.03	a)
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	200	0	0	200 EUR	82.12%	173'897.58	0.07	a)
IT0005474330	0.0000 % BTPS 0 12/15/24 3Y	80	100	0	180 EUR	95.43%	181'867.64	0.07	a)
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	75	25	0	100 EUR	56.78%	60'119.00	0.02	a)
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	150	0	0	150 EUR	90.71%	144'050.88	0.06	a)
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	100	50	0	150 EUR	95.08%	151'000.52	0.06	a)
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	0	250	0	250 EUR	84.56%	223'811.82	0.09	a)
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	0	250	100	150 EUR	92.69%	147'198.55	0.06	a)
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	0	135	0	135 EUR	82.51%	117'932.58	0.05	a)
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	80	112	0	192 EUR	94.68%	192'465.51	0.08	a)
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	0	137	0	137 EUR	92.97%	134'847.48	0.05	a)
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	0	139	0	139 EUR	99.11%	145'857.95	0.06	a)
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	0	181	0	181 EUR	97.14%	186'149.20	0.07	a)
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	0	105	0	105 EUR	91.93%	102'199.66	0.04	a)
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	78	0	78 EUR	89.94%	74'276.35	0.03	a)
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	0	200	0	200 EUR	99.13%	209'901.43	0.08	a)
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	0	206	0	206 EUR	99.65%	217'343.51	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	105	0	105 EUR	96.78%	107'588.01	0.04	a)
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	0	200	0	200 EUR	96.06%	203'413.41	0.08	a)
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	0	100	0	100 EUR	97.14%	102'844.86	0.04	a)
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	0	50	0	50 EUR	98.49%	52'136.03	0.02	a)
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	0	100	50	50 EUR	99.64%	52'747.46	0.02	a)
IT							16'094'703.46	6.38	
JP1024291MA8	0.0050 % JGB 0.005 10/01/23 429	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024301MB3	0.0050 % JGB 0.005 11/01/23 430	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024341N31	0.0050 % JGB 0.005 03/01/24 434	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024351N46	0.0050 % JGB 0.005 04/01/24 435	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024361N51	0.0050 % JGB 0.005 05/01/24 436	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024381N73	0.0050 % JGB 0.005 07/01/24 438	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024391N89	0.0050 % JGB 0.005 08/01/24 439	0	20'000	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024401N95	0.0050 % JGB 0.005 09/01/24 440	0	25'000	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	0	30'000	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024421NB7	0.0050 % JGB 0.005 11/01/24 442	0	15'000	0	15'000 JPY	100.06%	100'578.66	0.04	a)
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	0	20'000	0	20'000 JPY	100.06%	134'099.51	0.05	a)
JP1024441P12	0.0050 % JGB 0.005 01/01/25 444	0	35'000	0	35'000 JPY	100.04%	234'629.59	0.09	a)
JP1024451P27	0.0050 % JGB 0.005 02/01/25 445	0	30'000	0	30'000 JPY	100.03%	201'097.00	0.08	a)
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	0	23'000	0	23'000 JPY	100.02%	154'162.04	0.06	a)
JP1024471P49	0.0050 % JGB 0.005 04/01/25 447	0	27'000	0	27'000 JPY	100.00%	180'929.40	0.07	a)
JP1024481P54	0.0050 % JGB 0.005 05/01/25 448	0	25'000	0	25'000 JPY	100.00%	167'533.93	0.07	a)
JP1024491P60	0.0050 % JGB 0.005 06/01/25 449	0	30'000	0	30'000 JPY	99.97%	200'982.41	0.08	a)
JP1024501P76	0.0050 % JGB 0.005 07/01/25 450	0	10'000	0	10'000 JPY	99.96%	66'984.75	0.03	a)
JP1051381K12	0.1000 % JGB 0.1 12/20/23 138	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051411KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/24 141	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	20'000	0	0	20'000 JPY	100.16%	134'233.54	0.05	a)
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	0	15'000	0	15'000 JPY	100.15%	100'674.15	0.04	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	20'000	0	0	20'000 JPY	100.12%	134'186.63	0.05	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	20'000	0	0	20'000 JPY	100.09%	134'147.76	0.05	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	30'000	0	0	30'000 JPY	99.82%	200'672.81	0.08	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	40'000	0	20'000	20'000 JPY	99.69%	133'613.00	0.05	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	10'000	15'000	0	25'000 JPY	99.61%	166'875.52	0.07	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	20'000	0	0	20'000 JPY	99.48%	133'322.16	0.05	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	20'000	0	0	20'000 JPY	99.80%	133'760.43	0.05	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	10'000	0	0	10'000 JPY	99.33%	66'563.91	0.03	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	0	35'000	0	35'000 JPY	99.54%	233'470.93	0.09	a)
JP1051561P27	0.2000 % JGB 0.2 12/20/27 156	0	48'000	0	48'000 JPY	99.81%	321'050.76	0.13	a)
JP1051571P41	0.2000 % JGB 0.2 03/20/28 157	0	27'000	0	27'000 JPY	99.63%	180'270.80	0.07	a)
JP1051581P56	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 158	0	50'000	0	50'000 JPY	99.19%	332'357.18	0.13	a)
JP1051591P70	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 159	0	10'000	0	10'000 JPY	99.02%	66'356.17	0.03	a)
JP1103301D90	0.8000 % JGB 0.8 09/20/23 330	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103311DB5	0.6000 % JGB 0.6 09/20/23 331	80'000	0	80'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	45'000	0	45'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103331E36	0.6000 % JGB 0.6 03/20/24 333	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103341E67	0.6000 % JGB 0.6 06/20/24 334	14'000	0	14'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0.5 09/20/24 335	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	15'000	0	0	15'000 JPY	100.40%	100'920.42	0.04	a)
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	0	10'000	0	10'000 JPY	100.59%	67'410.29	0.03	a)
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	92'000	0	30'000	62'000 JPY	100.66%	418'213.84	0.17	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	10'000	0	0	10'000 JPY	100.05%	67'047.08	0.03	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	10'000	0	0	10'000 JPY	100.03%	67'033.00	0.03	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	22'000	0	0	22'000 JPY	99.97%	147'387.10	0.06	a)
JP1103451GC0	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	32'500	0	0	32'500 JPY	99.91%	217'602.45	0.09	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	25'000	0	0	25'000 JPY	99.80%	167'200.54	0.07	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	50'500	0	0	50'500 JPY	99.68%	337'332.22	0.13	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	10'000	0	0	10'000 JPY	99.54%	66'705.98	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	30'000	0	0	30'000 JPY	99.39%	199'818.40	0.08	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	35'000	0	20'000	15'000 JPY	99.19%	99'707.15	0.04	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	25'000	0	0	25'000 JPY	99.02%	165'890.43	0.07	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	15'000	0	0	15'000 JPY	98.88%	99'395.54	0.04	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	13'000	0	0	13'000 JPY	98.74%	86'015.61	0.03	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	0	14'000	0	14'000 JPY	98.57%	92'479.28	0.04	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	20'000	0	0	20'000 JPY	98.40%	131'885.41	0.05	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	36'000	0	25'000	11'000 JPY	97.97%	72'216.32	0.03	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	36'000	0	25'000	11'000 JPY	97.42%	71'811.63	0.03	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	21'000	0	11'000	10'000 JPY	97.13%	65'086.28	0.03	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	50'000	0	45'000	5'000 JPY	96.79%	32'429.55	0.01	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	43'000	0	20'000	23'000 JPY	96.51%	148'750.54	0.06	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	72'000	0	40'000	32'000 JPY	96.22%	206'337.54	0.08	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	10'000	10'000	0	20'000 JPY	95.92%	128'556.21	0.05	a)
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	0	10'000	0	10'000 JPY	98.03%	65'692.75	0.03	a)
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	0	62'000	35'000	27'000 JPY	97.80%	176'956.07	0.07	a)
JP1103711P74	0.4000 % JGB 0.4 06/20/33 371	0	17'000	0	17'000 JPY	96.66%	110'120.36	0.04	a)
JP1200701462	2.4000 % JGB 2.4 06/20/24 70	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	13'000	0	13'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	20'000	0	0	20'000 JPY	102.47%	137'332.22	0.05	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	25'000	0	0	25'000 JPY	104.30%	174'731.11	0.07	a)
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	20'000	0	0	20'000 JPY	104.97%	140'684.20	0.06	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	30'000	0	18'000	12'000 JPY	105.46%	84'805.36	0.03	a)
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	20'000	0	10'000	10'000 JPY	105.99%	71'026.30	0.03	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	13'000	0	0	13'000 JPY	106.18%	92'503.20	0.04	a)
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	16'000	0	0	16'000 JPY	106.32%	113'995.91	0.05	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	11'000	0	0	11'000 JPY	106.73%	78'672.94	0.03	a)
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	10'000	0	0	10'000 JPY	107.80%	72'237.90	0.03	a)
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	20'000	0	0	20'000 JPY	107.80%	144'482.49	0.06	a)
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	0	15'000	0	15'000 JPY	108.50%	109'058.47	0.04	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	10'000	0	0	10'000 JPY	109.76%	73'552.69	0.03	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	12'000	0	0	12'000 JPY	108.71%	87'419.67	0.03	a)
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	10'000	0	0	10'000 JPY	109.20%	73'177.42	0.03	a)
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	15'000	0	0	15'000 JPY	109.10%	109'662.59	0.04	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	10'000	0	0	10'000 JPY	108.07%	72'420.84	0.03	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	11'000	0	0	11'000 JPY	108.33%	79'854.58	0.03	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	12'000	0	0	12'000 JPY	109.40%	87'976.14	0.03	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	14'000	0	0	14'000 JPY	109.65%	102'869.63	0.04	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	25'000	0	15'000	10'000 JPY	109.94%	73'673.31	0.03	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	15'000	0	0	15'000 JPY	110.21%	110'779.36	0.04	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	10'000	0	0	10'000 JPY	110.81%	74'259.00	0.03	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	10'000	0	0	10'000 JPY	111.01%	74'393.70	0.03	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	20'000	0	0	20'000 JPY	110.39%	147'944.38	0.06	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	10'000	0	0	10'000 JPY	109.91%	73'652.54	0.03	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	9'000	0	0	9'000 JPY	108.61%	65'502.63	0.03	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	10'000	0	0	10'000 JPY	107.31%	71'908.86	0.03	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	12'000	0	0	12'000 JPY	109.44%	88'007.51	0.03	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	9'000	0	0	9'000 JPY	108.77%	65'599.73	0.03	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	15'000	0	0	15'000 JPY	110.89%	111'461.89	0.04	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	15'000	0	0	15'000 JPY	110.19%	110'763.28	0.04	a)
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	15'000	0	0	15'000 JPY	111.84%	112'423.86	0.04	a)
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	0	10'000	0	10'000 JPY	110.33%	73'935.33	0.03	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	45'500	0	20'000	25'500 JPY	109.81%	187'637.96	0.07	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	34'500	0	0	34'500 JPY	109.14%	252'323.37	0.10	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	53'000	0	0	53'000 JPY	109.17%	387'747.96	0.15	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	20'000	0	0	20'000 JPY	108.48%	145'395.21	0.06	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	0	17'000	0	17'000 JPY	107.68%	122'671.13	0.05	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	25'000	0	10'000	15'000 JPY	106.84%	107'389.85	0.04	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	28'500	0	0	28'500 JPY	108.55%	207'323.77	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	31'000	0	0	31'000 JPY	108.68%	225'761.43	0.09	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	11'000	0	0	11'000 JPY	109.54%	80'747.26	0.03	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	17'000	0	0	17'000 JPY	107.90%	122'925.18	0.05	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	12'000	0	0	12'000 JPY	106.92%	85'981.04	0.03	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	36'500	0	10'000	26'500 JPY	108.81%	193'225.80	0.08	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	26'000	0	0	26'000 JPY	108.81%	189'590.48	0.08	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	10'000	17'000	10'000	17'000 JPY	107.85%	122'860.24	0.05	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	25'000	0	0	25'000 JPY	106.81%	178'936.17	0.07	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	20'000	0	0	20'000 JPY	106.71%	143'021.61	0.06	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	34'500	0	12'000	22'500 JPY	105.60%	159'222.65	0.06	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	27'000	0	0	27'000 JPY	103.31%	186'923.77	0.07	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	21'000	0	0	21'000 JPY	103.23%	145'273.98	0.06	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	20'000	0	0	20'000 JPY	104.21%	139'661.58	0.06	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	30'000	0	10'000	20'000 JPY	102.95%	137'972.86	0.05	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	12'000	20'000	9'000	23'000 JPY	100.43%	154'798.59	0.06	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	15'000	0	0	15'000 JPY	93.21%	93'690.07	0.04	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	10'000	0	0	10'000 JPY	90.49%	60'640.64	0.02	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	18'000	0	0	18'000 JPY	93.70%	113'028.78	0.04	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	20'000	0	0	20'000 JPY	94.61%	126'803.15	0.05	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	25'000	0	0	25'000 JPY	95.55%	160'068.69	0.06	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	15'000	10'000	0	25'000 JPY	94.02%	157'505.44	0.06	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	20'000	17'000	15'000	22'000 JPY	93.65%	138'062.26	0.05	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	15'000	0	0	15'000 JPY	93.29%	93'771.49	0.04	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	20'000	10'000	0	30'000 JPY	91.68%	184'306.25	0.07	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	20'000	10'000	0	30'000 JPY	91.29%	183'518.18	0.07	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	21'000	0	0	21'000 JPY	93.66%	131'797.96	0.05	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	25'000	0	0	25'000 JPY	90.60%	151'784.22	0.06	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	0	32'000	10'000	22'000 JPY	88.80%	130'913.45	0.05	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	0	37'000	0	37'000 JPY	86.97%	215'637.66	0.09	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	0	10'000	0	10'000 JPY	86.48%	57'954.77	0.02	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	28'000	12'000	0	40'000 JPY	86.05%	230'663.76	0.09	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	35'000	0	0	35'000 JPY	87.14%	204'377.95	0.08	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	45'000	0	10'000	35'000 JPY	86.72%	203'385.83	0.08	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	43'000	0	0	43'000 JPY	86.29%	248'643.59	0.10	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	40'000	0	0	40'000 JPY	87.48%	234'502.26	0.09	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	40'000	0	0	40'000 JPY	87.07%	233'381.81	0.09	a)
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	35'000	12'000	0	47'000 JPY	85.17%	268'264.57	0.11	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	45'000	0	0	45'000 JPY	86.34%	260'368.24	0.10	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	20'000	20'000	0	40'000 JPY	86.04%	230'626.24	0.09	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	30'000	15'000	0	45'000 JPY	90.61%	273'235.72	0.11	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	10'000	35'000	10'000	35'000 JPY	91.88%	215'504.77	0.09	a)
JP1201821NA5	1.1000 % JGB 1.1 09/20/42 182	0	33'000	0	33'000 JPY	94.95%	209'966.02	0.08	a)
JP1201831P14	1.4000 % JGB 1.4 12/20/42 183	0	40'000	10'000	30'000 JPY	99.67%	200'383.31	0.08	a)
JP1201841P46	1.1000 % JGB 1.1 03/20/43 184	0	29'500	0	29'500 JPY	94.35%	186'516.70	0.07	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	0	15'000	0	15'000 JPY	94.11%	94'598.76	0.04	a)
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	0	7'000	0	7'000 JPY	108.81%	51'040.78	0.02	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	10'000	0	0	10'000 JPY	111.74%	74'880.21	0.03	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	19'000	10'000	19'000	10'000 JPY	115.72%	77'550.01	0.03	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	15'000	0	0	15'000 JPY	116.91%	117'515.16	0.05	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	0	10'000	0	10'000 JPY	117.11%	78'481.49	0.03	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	10'000	0	0	10'000 JPY	116.16%	77'841.51	0.03	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	17'500	15'000	17'500	15'000 JPY	115.15%	115'751.05	0.05	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	10'000	0	0	10'000 JPY	115.29%	77'257.83	0.03	a)
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	0	10'000	0	10'000 JPY	117.58%	78'795.78	0.03	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	20'000	0	10'600	9'400 JPY	115.41%	72'696.06	0.03	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	10'000	0	0	10'000 JPY	117.74%	78'903.67	0.03	a)
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	15'000	0	0	15'000 JPY	117.75%	118'363.55	0.05	a)
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	15'000	0	0	15'000 JPY	117.87%	118'482.16	0.05	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	10'000	0	0	10'000 JPY	115.51%	77'406.60	0.03	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	25'000	10'000	15'000	20'000 JPY	116.76%	156'493.89	0.06	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	15'000	0	0	15'000 JPY	118.15%	118'758.59	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	30'000	0	10'000	20'000 JPY	118.31%	158'564.58	0.06	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	20'000	10'000	10'000	20'000 JPY	116.86%	156'617.19	0.06	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	22'000	10'000	20'000	12'000 JPY	115.46%	92'845.30	0.04	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	91'000	0	61'000	30'000 JPY	113.85%	228'874.52	0.09	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	30'000	0	0	30'000 JPY	115.19%	231'580.50	0.09	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	35'000	0	0	35'000 JPY	110.50%	259'165.35	0.10	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	30'000	8'000	10'000	28'000 JPY	113.37%	212'730.57	0.08	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	40'000	20'000	23'700	36'300 JPY	110.20%	268'076.32	0.11	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	35'000	0	0	35'000 JPY	110.02%	258'053.61	0.10	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	44'500	0	0	44'500 JPY	108.16%	322'526.22	0.13	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	20'000	5'000	0	25'000 JPY	106.22%	177'954.43	0.07	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	25'000	0	6'500	18'500 JPY	107.79%	133'627.71	0.05	a)
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	0	15'000	0	15'000 JPY	105.93%	106'484.17	0.04	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	25'000	0	10'000	15'000 JPY	104.06%	104'603.45	0.04	a)
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	15'000	0	0	15'000 JPY	104.08%	104'620.54	0.04	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	10'000	0	0	10'000 JPY	104.02%	69'704.81	0.03	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	17'000	0	0	17'000 JPY	103.87%	118'326.15	0.05	a)
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	10'000	0	0	10'000 JPY	100.15%	67'116.10	0.03	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	20'000	0	0	20'000 JPY	100.05%	134'096.83	0.05	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	10'000	0	0	10'000 JPY	101.76%	68'189.65	0.03	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	10'000	0	0	10'000 JPY	97.96%	65'643.16	0.03	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	15'000	0	10'000	5'000 JPY	97.84%	32'781.71	0.01	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	10'000	10'000	0	20'000 JPY	86.33%	115'701.79	0.05	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	12'000	0	0	12'000 JPY	76.64%	61'633.64	0.02	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	19'500	0	0	19'500 JPY	80.19%	104'787.10	0.04	a)
JP1300531GCO	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	15'500	0	0	15'500 JPY	81.82%	84'985.39	0.03	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	20'000	0	8'000	12'000 JPY	85.53%	68'776.14	0.03	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	10'000	8'000	5'000	13'000 JPY	85.32%	74'330.64	0.03	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	15'000	0	0	15'000 JPY	85.05%	85'489.70	0.03	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	15'000	0	0	15'000 JPY	84.77%	85'213.27	0.03	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	19'000	0	0	19'000 JPY	84.57%	107'677.06	0.04	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	15'000	15'000	8'000	22'000 JPY	82.27%	121'283.43	0.05	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	15'000	0	0	15'000 JPY	85.99%	86'433.57	0.03	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	20'000	0	0	20'000 JPY	81.62%	109'394.54	0.04	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	20'000	0	10'000	10'000 JPY	77.21%	51'740.66	0.02	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	27'000	0	0	27'000 JPY	74.76%	135'265.07	0.05	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	0	32'000	15'000	17'000 JPY	74.45%	84'809.18	0.03	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	0	30'000	0	30'000 JPY	74.20%	149'168.71	0.06	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	20'000	0	0	20'000 JPY	77.89%	104'391.36	0.04	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	38'000	0	0	38'000 JPY	77.59%	197'587.27	0.08	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	32'000	0	0	32'000 JPY	79.61%	170'714.56	0.07	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	35'000	0	0	35'000 JPY	79.40%	186'217.12	0.07	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	35'000	0	0	35'000 JPY	79.18%	185'708.16	0.07	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	30'000	0	0	30'000 JPY	78.96%	158'744.18	0.06	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	20'000	20'000	20'000	20'000 JPY	78.89%	105'736.97	0.04	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	20'000	0	0	20'000 JPY	85.40%	114'455.35	0.05	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	25'000	17'000	10'800	31'200 JPY	92.05%	192'462.55	0.08	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	0	32'500	0	32'500 JPY	94.28%	205'342.94	0.08	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	0	32'000	7'000	25'000 JPY	98.81%	165'540.29	0.07	a)
JP1300781P48	1.4000 % JGB 1.4 03/20/53 78	0	30'850	0	30'850 JPY	94.17%	194'684.23	0.08	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	0	10'000	0	10'000 JPY	89.46%	59'949.07	0.02	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	10'000	0	0	10'000 JPY	116.90%	78'340.76	0.03	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	20'000	0	10'000	10'000 JPY	112.55%	75'422.35	0.03	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	43'000	0	15'000	28'000 JPY	112.48%	211'045.60	0.08	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	21'000	0	0	21'000 JPY	112.38%	158'144.88	0.06	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	25'000	0	0	25'000 JPY	108.00%	180'929.80	0.07	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	13'000	0	0	13'000 JPY	105.86%	92'225.30	0.04	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	10'000	5'000	0	15'000 JPY	101.08%	101'606.97	0.04	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	15'000	0	0	15'000 JPY	93.65%	94'132.35	0.04	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	28'000	0	0	28'000 JPY	68.45%	128'427.54	0.05	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	20'000	10'000	0	30'000 JPY	80.39%	161'613.00	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	30'000	0	6'000	24'000 JPY	77.21%	124'177.58	0.05	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	27'000	0	0	27'000 JPY	68.57%	124'068.82	0.05	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	41'000	4'000	0	45'000 JPY	67.79%	204'426.20	0.08	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	33'000	26'900	17'000	42'900 JPY	72.40%	208'130.76	0.08	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	10'000	33'000	10'000	33'000 JPY	79.50%	175'797.29	0.07	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	0	15'450	0	15'450 JPY	86.91%	89'980.14	0.04	a)
JP							30'293'712.99	12.01	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	20'000	0	20'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	30'000	0	0	30'000 MXN	98.95%	170'807.52	0.07	a)
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	6'000	0	0	6'000 MXN	101.00%	34'869.77	0.01	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	50'000	0	12'000	38'000 MXN	91.56%	200'197.71	0.08	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	30'000	0	0	30'000 MXN	93.84%	161'997.70	0.06	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	25'000	0	0	25'000 MXN	88.72%	127'627.71	0.05	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	22'000	32'000	7'150	46'850 MXN	88.41%	238'338.18	0.09	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	17'500	15'000	0	32'500 MXN	80.98%	151'433.55	0.06	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	23'100	0	12'850	10'250 MXN	85.78%	50'595.40	0.02	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	36'000	14'000	0	50'000 MXN	89.94%	258'774.22	0.10	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	23'400	9'250	0	32'650 MXN	82.71%	155'390.88	0.06	a)
MX0MGO000151	8.0000 % MBONO 8 09/05/24 M	29'000	0	29'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000193	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	0	9'000	0	9'000 MXN	91.27%	47'269.07	0.02	a)
MX0MGO0001B0	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	0	32'000	11'000	21'000 MXN	92.74%	112'065.51	0.04	a)
MX0MGO0001C8	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	10'000	22'000	0	32'000 MXN	86.32%	158'949.98	0.06	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	0	23'200	0	23'200 MXN	85.31%	113'889.88	0.05	a)
MX0MGO0001E4	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	0	15'000	0	15'000 MXN	82.07%	70'837.13	0.03	a)
MX							2'053'044.21	0.81	
MYBML1700020	4.0590 % MGS 4.059 09/30/24 0217	400	0	0	400 MYR	100.69%	85'777.75	0.03	a)
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	500	0	0	500 MYR	100.92%	107'470.31	0.04	a)
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	300	0	0	300 MYR	100.89%	64'464.94	0.03	a)
MYBMO2000028	2.6320 % MGS 2.632 04/15/31 0220	500	0	0	500 MYR	91.42%	97'348.38	0.04	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	400	0	0	400 MYR	97.05%	82'675.89	0.03	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	200	0	0	200 MYR	99.78%	42'502.53	0.02	a)
MYBMS1900047	3.8280 % MGS 3.828 07/05/34 0419	500	0	0	500 MYR	97.86%	104'209.57	0.04	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	400	0	0	400 MYR	105.48%	89'864.44	0.04	a)
MYBMX0700034	3.5020 % MGS 3.502 05/31/27 0307	400	250	0	650 MYR	99.36%	137'544.86	0.05	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	500	0	0	500 MYR	103.45%	110'162.40	0.04	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	300	0	0	300 MYR	106.24%	67'882.01	0.03	a)
MYBMY1900052	3.7570 % MGS 3.757 05/22/40 0519	200	0	0	200 MYR	94.09%	40'078.80	0.02	a)
MYBMY2200023	4.6960 % MGS 4.696 10/15/42 0222	0	450	0	450 MYR	105.00%	100'628.82	0.04	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	140	0	0	140 MYR	104.57%	31'180.02	0.01	a)
MYBMZ1800051	4.9210 % MGS 4.921 07/06/48 0518	0	205	0	205 MYR	106.78%	46'621.37	0.02	a)
MYBMZ2000016	4.0650 % MGS 4.065 06/15/50 0120	150	205	0	355 MYR	93.64%	70'796.61	0.03	a)
MY							1'279'208.70	0.51	
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	175	50	50	175 EUR	107.64%	199'436.75	0.08	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	140	0	0	140 EUR	109.71%	162'617.65	0.06	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	223	50	80	193 EUR	105.95%	216'496.91	0.09	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	130	60	0	190 EUR	94.97%	191'044.03	0.08	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	252	0	30	222 EUR	91.61%	215'322.44	0.09	a)
NL0010733424	2.0000 % NETHER 2 07/15/24	190	0	190	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	173	100	175	98 EUR	94.84%	98'403.62	0.04	a)
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	210	0	0	210 EUR	93.17%	207'151.86	0.08	a)
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	145	60	0	205 EUR	92.04%	199'767.08	0.08	a)
NL0012650469	0.0000 % NETHER 0 01/15/24	144	0	144	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	137	130	50	217 EUR	90.05%	206'888.76	0.08	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	100	0	0	100 EUR	85.52%	90'544.30	0.04	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	132	50	0	182 EUR	65.15%	125'539.17	0.05	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	157	0	0	157 EUR	81.65%	135'721.70	0.05	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	200	0	50	150 EUR	79.01%	125'477.76	0.05	a)
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	120	0	0	120 EUR	62.75%	79'723.88	0.03	a)
NL0015000L58	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	140	0	0	140 EUR	85.37%	126'539.69	0.05	a)
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	50	100	0	150 EUR	93.08%	147'814.74	0.06	a)
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	0	165	0	165 EUR	80.08%	139'894.76	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	0	85	0	85 EUR	75.93%	68'332.26	0.03	a)
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	0	80	0	80 EUR	94.36%	79'922.92	0.03	a)
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	0	75	0	75 EUR	96.78%	76'849.37	0.03	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	175	0	0	175 EUR	90.62%	167'901.88	0.07	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	75	143	0	218 EUR	41.12%	94'908.05	0.04	a)
NL							3'156'299.58	1.25	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	1'850	0	1'850	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	0	600	0	600 NOK	96.52%	54'424.22	0.02	a)
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	700	0	0	700 NOK	94.05%	61'869.40	0.02	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	0	450	0	450 NOK	92.56%	39'143.49	0.02	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	500	0	0	500 NOK	91.43%	42'961.79	0.02	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	350	0	0	350 NOK	88.08%	28'971.37	0.01	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	230	300	0	530 NOK	84.31%	41'994.66	0.02	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	600	0	0	600 NOK	81.30%	45'842.20	0.02	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	0	350	0	350 NOK	86.42%	28'424.37	0.01	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	0	400	0	400 NOK	92.19%	34'656.25	0.01	a)
NO							378'287.75	0.15	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	0	80	0	80 NZD	95.63%	45'968.08	0.02	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	0	80	0	80 NZD	97.13%	46'690.07	0.02	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	0	80	0	80 NZD	89.12%	42'837.68	0.02	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	0	120	0	120 NZD	86.44%	62'324.28	0.02	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	0	60	0	60 NZD	74.18%	26'743.27	0.01	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	0	80	80	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	0	60	0	60 NZD	87.97%	31'714.26	0.01	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	0	150	0	150 NZD	79.56%	71'701.64	0.03	a)
NZGOVDT530C2	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/30 0530	0	100	0	100 NZD	95.57%	57'425.49	0.02	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	0	60	0	60 NZD	76.35%	27'524.01	0.01	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	0	150	0	150 NZD	77.28%	69'653.11	0.03	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	0	40	0	40 NZD	90.96%	21'860.47	0.01	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	0	40	0	40 NZD	57.70%	13'867.31	0.01	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	0	50	0	50 NZD	60.77%	18'256.87	0.01	a)
NZ							536'566.54	0.21	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	600	0	0	600 PLN	101.68%	139'764.72	0.06	a)
PL0000107264	4.0000 % POLGB 4 10/25/23 1023	200	0	200	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	0	400	0	400 PLN	90.20%	82'656.56	0.03	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	220	0	0	220 PLN	96.95%	48'863.13	0.02	a)
PL0000108866	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/26 0726	300	0	0	300 PLN	93.40%	64'191.70	0.03	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	450	300	0	750 PLN	90.95%	156'269.69	0.06	a)
PL0000111191	2.5000 % POLGB 2 1/2 04/25/24 0424	220	0	220	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	260	0	0	260 PLN	86.63%	51'600.33	0.02	a)
PL0000111720	2.2500 % POLGB 2 1/4 10/25/24 1024	500	0	500	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	550	200	0	750 PLN	93.79%	161'149.36	0.06	a)
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	380	250	0	630 PLN	75.39%	108'809.06	0.04	a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	450	400	0	850 PLN	86.53%	168'498.64	0.07	a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	0	450	0	450 PLN	72.79%	75'040.38	0.03	a)
PL							1'056'843.57	0.42	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	750	0	0	750 SEK	105.30%	72'693.57	0.03	a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	0	400	0	400 SEK	94.14%	34'661.36	0.01	a)
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	1'000	0	1'000	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	750	0	0	750 SEK	98.41%	67'932.98	0.03	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	950	0	0	950 SEK	93.37%	81'644.80	0.03	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	450	0	0	450 SEK	89.98%	37'270.53	0.01	a)
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	750	0	0	750 SEK	87.51%	60'413.79	0.02	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	750	0	0	750 SEK	80.81%	55'787.81	0.02	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	0	500	0	500 SEK	89.81%	41'333.92	0.02	a)
SE							451'738.76	0.18	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	100	25	0	125 SGD	97.80%	89'567.00	0.04	a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	90	0	0	90 SGD	93.08%	61'375.93	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	75	0	0	75 SGD	96.17%	52'844.53	0.02	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	70	60	0	130 SGD	88.58%	84'368.09	0.03	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	50	25	0	75 SGD	96.98%	53'289.62	0.02	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	40	25	0	65 SGD	93.35%	44'455.64	0.02	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	75	0	0	75 SGD	99.76%	54'817.20	0.02	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	100	0	0	100 SGD	97.31%	71'294.60	0.03	a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	165	0	0	165 SGD	100.18%	121'105.58	0.05	a)
SG7530941627	3.0000 % SIGB 3 09/01/24	40	30	70	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	75	25	0	100 SGD	96.71%	70'855.01	0.03	a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	0	65	0	65 SGD	93.38%	44'469.92	0.02	a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	50	0	0	50 SGD	88.88%	32'559.16	0.01	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	35	35	0	70 SGD	77.16%	39'572.13	0.02	a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	50	0	0	50 SGD	93.62%	34'295.55	0.01	a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	0	30	0	30 SGD	94.17%	20'698.22	0.01	a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	0	30	0	30 SGD	98.86%	21'729.06	0.01	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	0	70	0	70 SGD	87.92%	45'090.48	0.02	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	50	0	0	50 SGD	77.38%	28'346.40	0.01	a)
SGXF92110679	2.0000 % SIGB 2 02/01/24	100	0	100	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SG							970'734.12	0.38	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	150	0	85	65 USD	101.84%	66'198.44	0.03	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	300	0	100	200 USD	105.14%	210'281.24	0.08	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	70	0	0	70 USD	102.50%	71'750.00	0.03	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	80	0	0	80 USD	108.91%	87'125.00	0.03	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	77	0	0	77 USD	104.53%	80'489.06	0.03	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	125	0	0	125 USD	99.67%	124'589.85	0.05	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	100	0	0	100 USD	103.75%	103'750.00	0.04	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	100	0	0	100 USD	96.86%	96'859.38	0.04	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	100	0	0	100 USD	97.73%	97'734.38	0.04	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	0	80	0	80 USD	86.33%	69'062.50	0.03	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	150	0	0	150 USD	94.20%	141'304.68	0.06	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	200	0	0	200 USD	96.83%	193'656.24	0.08	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	100	0	0	100 USD	95.13%	95'125.00	0.04	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	150	0	0	150 USD	97.88%	146'812.50	0.06	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	100	0	0	100 USD	94.78%	94'781.25	0.04	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	200	0	50	150 USD	88.72%	133'078.13	0.05	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	200	0	60	140 USD	92.95%	130'134.37	0.05	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	350	0	200	150 USD	98.86%	148'289.07	0.06	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	118	0	0	118 USD	94.22%	111'178.13	0.04	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	152	0	0	152 USD	86.50%	131'480.00	0.05	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	100	40	0	140 USD	78.59%	110'031.25	0.04	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	150	0	0	150 USD	78.33%	117'492.18	0.05	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	170	0	0	170 USD	76.50%	130'050.00	0.05	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	150	50	0	200 USD	73.22%	146'437.50	0.06	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	250	0	0	250 USD	72.94%	182'343.75	0.07	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	175	55	0	230 USD	77.38%	177'962.50	0.07	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	330	100	110	320 USD	74.03%	236'900.00	0.09	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	180	75	0	255 USD	83.41%	212'685.94	0.08	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	190	128	0	318 USD	84.84%	269'803.13	0.11	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	290	0	60	230 USD	83.13%	191'187.50	0.08	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	150	100	0	250 USD	79.77%	199'414.05	0.08	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	290	50	0	340 USD	76.38%	259'675.00	0.10	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	280	0	0	280 USD	74.59%	208'862.50	0.08	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	300	100	90	340 USD	67.91%	230'881.25	0.09	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	130	133	50	183 USD	74.22%	135'820.31	0.05	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	210	0	0	210 USD	72.41%	152'053.13	0.06	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	130	0	0	130 USD	73.94%	96'118.75	0.04	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	280	0	0	280 USD	67.08%	187'818.74	0.07	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	280	0	0	280 USD	66.95%	187'468.74	0.07	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	318	144	110	352 USD	63.38%	223'080.00	0.09	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	140	0	0	140 USD	71.78%	100'493.75	0.04	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	300	60	0	360 USD	73.41%	264'262.50	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	200	50	0	250 USD	73.34%	183'359.38	0.07	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	370	135	155	350 USD	69.81%	244'343.75	0.10	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	330	65	0	395 USD	69.72%	275'389.06	0.11	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	360	90	150	300 USD	73.17%	219'515.64	0.09	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	400	50	0	450 USD	74.91%	337'078.13	0.13	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	400	164	100	464 USD	73.11%	339'227.52	0.13	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	460	85	60	485 USD	78.45%	380'497.63	0.15	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	470	105	65	510 USD	73.13%	372'937.50	0.15	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	460	100	70	490 USD	71.34%	349'584.38	0.14	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	460	30	0	490 USD	62.25%	305'025.00	0.12	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	390	154	100	444 USD	64.00%	284'160.00	0.11	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	530	100	75	555 USD	58.36%	323'894.56	0.13	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	710	150	215	645 USD	47.19%	304'359.38	0.12	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	780	0	0	780 USD	48.81%	380'737.50	0.15	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	480	0	0	480 USD	56.78%	272'550.00	0.11	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	510	100	100	510 USD	57.34%	292'453.13	0.12	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	700	110	90	720 USD	52.38%	377'100.00	0.15	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	400	230	0	630 USD	59.11%	372'389.09	0.15	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	835	100	130	805 USD	56.06%	451'303.13	0.18	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	579	300	165	714 USD	64.50%	460'530.00	0.18	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	850	0	0	850 USD	63.44%	539'218.75	0.21	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	700	0	82	618 USD	68.58%	423'812.78	0.17	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	800	100	150	750 USD	57.73%	433'007.85	0.17	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	850	75	115	810 USD	62.25%	504'225.00	0.20	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	750	85	90	745 USD	55.77%	415'453.87	0.16	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	450	325	95	680 USD	64.88%	441'150.00	0.17	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	600	165	85	680 USD	61.41%	417'562.50	0.17	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	400	216	80	536 USD	69.11%	370'426.28	0.15	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	360	349	60	649 USD	70.94%	460'384.38	0.18	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	400	155	100	455 USD	79.70%	362'649.20	0.14	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	240	450	0	690 USD	72.91%	503'053.13	0.20	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	180	297	70	407 USD	81.08%	329'987.95	0.13	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	0	685	0	685 USD	88.66%	607'295.31	0.24	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	0	497	90	407 USD	88.78%	361'339.69	0.14	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	0	688	0	688 USD	82.77%	569'427.47	0.23	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	0	470	60	410 USD	87.05%	356'892.21	0.14	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	680	0	680 USD	82.83%	563'231.22	0.22	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 05/15/43	0	450	0	450 USD	86.95%	391'289.04	0.16	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	0	75	0	75 USD	93.34%	70'007.81	0.03	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	600	50	0	650 USD	91.16%	592'515.63	0.23	a)
US9128282D10	1.3750 % T 1 3/8 08/31/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	200	200	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	500	0	0	500 USD	91.39%	456'953.10	0.18	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	338	0	338	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	200	100	220	80 USD	96.80%	77'437.50	0.03	a)
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	250	0	0	250 USD	96.67%	241'679.70	0.10	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	400	140	0	540 USD	90.94%	491'062.50	0.19	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	250	0	0	250 USD	96.31%	240'781.25	0.10	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	350	0	80	270 USD	96.27%	259'917.17	0.10	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	320	0	0	320 USD	96.36%	308'350.02	0.12	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	650	108	105	653 USD	92.47%	603'820.94	0.24	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	350	0	0	350 USD	96.53%	337'859.38	0.13	a)
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	200	0	0	200 USD	96.19%	192'375.00	0.08	a)
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	350	0	0	350 USD	96.42%	337'476.58	0.13	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	630	170	105	695 USD	92.66%	643'960.94	0.26	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	800	200	260	740 USD	92.33%	683'228.09	0.27	a)
US9128284X55	2.7500 % T 2 3/4 08/31/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	220	0	0	220 USD	95.72%	210'581.25	0.08	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	280	0	40	240 USD	96.09%	230'625.00	0.09	a)
US9128285D82	2.8750 % T 2 7/8 09/30/23	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	200	0	0	200 USD	96.00%	192'000.00	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US9128285K26	2.8750 % T 2 7/8 10/31/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	626	100	80	646 USD	93.11%	601'486.59	0.24	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	250	0	0	250 USD	95.63%	239'062.50	0.09	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	250	0	0	250 USD	95.03%	237'578.13	0.09	a)
US9128285U08	2.6250 % T 2 5/8 12/31/23	260	0	260	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	150	175	45	280 USD	94.88%	265'650.00	0.11	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	750	0	100	650 USD	90.45%	587'945.28	0.23	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	300	0	0	300 USD	94.53%	283'593.75	0.11	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	200	200	150	250 USD	93.83%	234'570.30	0.09	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	648	0	648	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	150	100	40	210 USD	93.94%	197'268.75	0.08	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	500	95	65	530 USD	88.84%	470'871.88	0.19	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	200	115	55	260 USD	93.19%	242'287.50	0.10	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	250	0	0	250 USD	92.50%	231'250.00	0.09	a)
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	1'010	0	1'010	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	900	100	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	1'205	0	125	1'080 USD	96.56%	1'042'875.00	0.41	a)
US9128288J272	2.0000 % T 2 02/15/25	600	0	0	600 USD	95.61%	573'656.28	0.23	a)
US9128288K742	2.0000 % T 2 08/15/25	700	0	105	595 USD	94.45%	561'996.06	0.22	a)
US9128288M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	580	131	80	631 USD	94.47%	596'097.81	0.24	a)
US9128288P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	550	0	0	550 USD	92.63%	509'437.50	0.20	a)
US9128288R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	500	100	50	550 USD	92.03%	506'171.88	0.20	a)
US9128288T263	1.3750 % T 1 3/8 09/30/23	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288T917	1.6250 % T 1 5/8 10/31/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288U246	2.0000 % T 2 11/15/26	550	0	0	550 USD	91.97%	505'828.13	0.20	a)
US9128288U576	2.1250 % T 2 1/8 11/30/23	480	0	480	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	530	0	530	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	550	0	55	495 USD	92.28%	456'792.19	0.18	a)
US9128288W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	230	0	230	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288WE61	2.7500 % T 2 3/4 11/15/23	490	0	490	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	707	0	707	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288X703	2.0000 % T 2 04/30/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	660	0	65	595 USD	92.22%	548'701.56	0.22	a)
US9128288XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	1'590	0	1'040	550 USD	95.22%	523'703.13	0.21	a)
US9128288XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	150	0	0	150 USD	96.00%	144'000.00	0.06	a)
US9128288Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	200	0	0	200 USD	96.06%	192'125.00	0.08	a)
US9128288Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	232	0	0	232 USD	92.25%	214'020.00	0.08	a)
US9128288YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	500	0	0	500 USD	84.84%	424'218.75	0.17	a)
US9128288YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	200	65	0	265 USD	90.72%	240'404.69	0.10	a)
US9128288YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	400	0	200	200 USD	91.27%	182'531.24	0.07	a)
US9128288YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	450	0	100	350 USD	95.89%	335'617.17	0.13	a)
US9128288YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	200	150	100	250 USD	90.97%	227'421.88	0.09	a)
US9128288YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	450	100	185	365 USD	85.05%	310'421.11	0.12	a)
US9128288YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	200	50	0	250 USD	90.80%	226'992.20	0.09	a)
US9128288YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	320	100	50	370 USD	95.64%	353'870.29	0.14	a)
US9128288YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	240	0	0	240 USD	91.00%	218'400.00	0.09	a)
US9128288YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	450	0	110	340 USD	95.66%	325'231.25	0.13	a)
US9128288Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	250	150	0	400 USD	94.94%	379'750.00	0.15	a)
US9128288Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	803	200	175	828 USD	90.03%	745'458.75	0.30	a)
US9128288Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	605	105	75	635 USD	82.89%	526'355.44	0.21	a)
US9128288ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	100	150	102	148 USD	88.75%	131'172.50	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	370	0	0	370 USD	94.36%	349'129.71	0.14	a)
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	220	0	0	220 USD	86.86%	191'090.64	0.08	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	400	0	0	400 USD	93.19%	372'750.00	0.15	a)
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	0	275	0	275 USD	92.69%	254'890.63	0.10	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	300	100	55	345 USD	86.22%	297'454.69	0.12	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	850	200	150	900 USD	77.39%	696'515.58	0.28	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	319	0	0	319 USD	85.91%	274'040.94	0.11	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	400	200	0	600 USD	92.19%	553'125.00	0.22	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	350	95	45	400 USD	85.66%	342'625.00	0.14	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	550	0	0	550 USD	91.89%	505'398.41	0.20	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	555	0	65	490 USD	91.55%	448'579.71	0.18	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	500	0	30	470 USD	84.94%	399'206.25	0.16	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	1'105	300	70	1'335 USD	76.73%	1'024'403.97	0.41	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	370	0	0	370 USD	85.09%	314'846.88	0.12	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	550	0	60	490 USD	91.22%	446'971.88	0.18	a)
US91282CAK71	0.1250 % T 0 1/8 09/15/23	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	520	0	0	520 USD	84.41%	438'912.50	0.17	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	540	150	125	565 USD	90.98%	514'061.75	0.20	a)
US91282CAP68	0.1250 % T 0 1/8 10/15/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	530	150	100	580 USD	90.64%	525'715.60	0.21	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	200	367	59	508 USD	84.58%	429'487.69	0.17	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	1'244	204	180	1'268 USD	77.78%	986'266.25	0.39	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	458	0	458	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	495	0	0	495 USD	84.78%	419'667.19	0.17	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	500	150	95	555 USD	90.58%	502'708.57	0.20	a)
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	430	0	430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	552	170	75	647 USD	84.56%	547'119.38	0.22	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	540	125	70	595 USD	90.38%	537'731.25	0.21	a)
US91282CBE03	0.1250 % T 0 1/8 01/15/24	594	0	594	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	673	0	0	673 USD	90.00%	605'700.00	0.24	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	782	0	120	662 USD	84.78%	561'251.88	0.22	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	1'042	219	125	1'136 USD	78.84%	895'665.00	0.35	a)
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	570	0	570	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	683	125	140	668 USD	86.03%	574'688.75	0.23	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	620	100	70	650 USD	90.02%	585'101.53	0.23	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	640	110	140	610 USD	86.31%	526'506.25	0.21	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	612	0	0	612 USD	90.41%	553'286.25	0.22	a)
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	550	114	55	609 USD	90.08%	548'575.75	0.22	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	670	150	150	670 USD	86.09%	576'828.13	0.23	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	1'040	210	125	1'125 USD	81.17%	913'183.65	0.36	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	700	150	180	670 USD	85.86%	575'257.85	0.23	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	600	100	65	635 USD	89.78%	570'110.94	0.23	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	650	140	170	620 USD	85.63%	530'875.00	0.21	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	600	0	0	600 USD	89.97%	539'812.50	0.21	a)
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	550	200	0	750 USD	89.00%	667'500.00	0.26	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	700	148	190	658 USD	84.34%	554'981.88	0.22	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	1'293	80	140	1'233 USD	78.16%	963'666.56	0.38	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	350	300	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCU36	0.1250 % T 0 1/8 08/31/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	550	100	0	650 USD	84.69%	550'468.75	0.22	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	650	0	0	650 USD	89.05%	578'804.72	0.23	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	750	146	240	656 USD	84.97%	557'395.00	0.22	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	650	0	0	650 USD	89.23%	580'023.47	0.23	a)
US91282CDA62	0.2500 % T 0 1/4 09/30/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	650	0	0	650 USD	95.17%	618'617.22	0.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CDD02	0.3750 % T 0 3/8 10/31/23	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	85.31%	554'531.25	0.22	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	700	0	80	620 USD	89.59%	555'481.25	0.22	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	0	648	0	648 USD	94.95%	615'296.22	0.24	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	1'200	130	130	1'200 USD	78.38%	940'500.00	0.37	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	700	0	65	635 USD	89.72%	569'714.06	0.23	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	600	100	75	625 USD	85.69%	535'546.88	0.21	a)
US91282CDM01	0.5000 % T 0 1/2 11/30/23	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	500	140	55	585 USD	94.94%	555'384.38	0.22	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	600	50	0	650 USD	84.92%	551'992.22	0.22	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	400	243	0	643 USD	89.58%	575'987.31	0.23	a)
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	0	630	70	560 USD	94.78%	530'775.00	0.21	a)
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	400	245	75	570 USD	86.42%	492'604.72	0.20	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	1'150	110	125	1'135 USD	81.22%	921'832.81	0.37	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	500	125	0	625 USD	94.97%	593'554.69	0.24	a)
US91282CEA53	1.5000 % T 1 1/2 02/29/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	550	0	0	550 USD	86.84%	477'640.63	0.19	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	0	600	0	600 USD	91.02%	546'093.72	0.22	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	500	150	0	650 USD	95.08%	618'007.78	0.24	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	300	291	85	506 USD	89.02%	450'419.04	0.18	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	500	105	55	550 USD	92.88%	510'812.50	0.20	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	0	555	0	555 USD	96.16%	533'667.19	0.21	a)
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	400	135	60	475 USD	91.31%	433'734.38	0.17	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	400	182	55	527 USD	93.52%	492'827.32	0.20	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	650	570	120	1'100 USD	87.78%	965'593.75	0.38	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	460	0	0	460 USD	96.19%	442'462.50	0.18	a)
US91282CER88	2.5000 % T 2 1/2 05/31/24	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CES61	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	370	140	55	455 USD	90.59%	412'201.56	0.16	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	500	100	80	520 USD	92.97%	483'437.50	0.19	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	350	185	0	535 USD	96.25%	514'937.50	0.20	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	250	261	80	431 USD	92.92%	400'493.30	0.16	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	450	136	80	506 USD	95.00%	480'700.00	0.19	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	400	150	85	465 USD	96.34%	447'998.44	0.18	a)
US91282CFA45	3.0000 % T 3 07/31/24	150	400	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	430	150	85	495 USD	93.16%	461'123.44	0.18	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	200	200	0	400 USD	89.73%	358'937.52	0.14	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	0	512	60	452 USD	96.47%	436'038.75	0.17	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	300	887	120	1'067 USD	86.59%	923'955.31	0.37	a)
US91282CFG15	3.2500 % T 3 1/4 08/31/24	300	250	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	400	250	165	485 USD	94.38%	457'718.75	0.18	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	0	450	50	400 USD	92.16%	368'625.00	0.15	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	0	442	0	442 USD	97.06%	429'016.25	0.17	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	0	435	45	390 USD	95.94%	374'156.25	0.15	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	0	526	50	476 USD	97.91%	466'033.75	0.18	a)
US91282CFN65	4.2500 % T 4 1/4 09/30/24	0	460	460	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	0	457	0	457 USD	98.42%	449'787.99	0.18	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	0	453	75	378 USD	96.53%	364'888.13	0.14	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	0	275	0	275 USD	97.88%	269'156.25	0.11	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	0	1'188	120	1'068 USD	96.45%	1'030'119.32	0.41	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	0	440	0	440 USD	98.94%	435'325.00	0.17	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	0	504	50	454 USD	98.97%	449'318.13	0.18	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	0	400	0	400 USD	95.84%	383'375.00	0.15	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	0	550	85	465 USD	96.94%	450'759.38	0.18	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	0	509	75	434 USD	97.91%	424'913.13	0.17	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	0	454	75	379 USD	95.80%	363'070.18	0.14	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	0	520	55	465 USD	96.94%	450'759.38	0.18	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	0	501	0	501 USD	98.63%	494'111.25	0.20	a)
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	0	535	105	430 USD	97.63%	419'787.50	0.17	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	0	453	0	453 USD	98.44%	445'921.88	0.18	a)
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	0	520	55	465 USD	95.47%	443'929.69	0.18	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	0	420	40	380 USD	93.73%	356'190.64	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	0	507	75	432 USD	97.88%	422'820.00	0.17	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	0	1'188	0	1'188 USD	91.78%	1'090'361.25	0.43	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	0	453	0	453 USD	99.08%	448'823.88	0.18	a)
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	0	566	75	491 USD	97.42%	478'341.43	0.19	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	0	454	75	379 USD	96.44%	365'498.13	0.14	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	0	508	75	433 USD	99.30%	429'955.49	0.17	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	0	350	0	350 USD	94.34%	330'203.13	0.13	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	0	520	55	465 USD	95.88%	445'818.75	0.18	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	0	506	0	506 USD	98.00%	495'880.00	0.20	a)
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	0	450	0	450 USD	97.25%	437'625.00	0.17	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	0	275	0	275 USD	97.94%	269'328.13	0.11	a)
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	0	450	70	380 USD	93.59%	355'656.25	0.14	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	0	520	55	465 USD	95.31%	443'203.13	0.18	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	0	500	70	430 USD	96.94%	416'831.25	0.17	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	1'200	0	1'200 USD	90.72%	1'088'625.00	0.43	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	0	350	0	350 USD	98.50%	344'750.00	0.14	a)
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	0	500	0	500 USD	95.86%	479'296.90	0.19	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	0	350	0	350 USD	94.94%	332'281.25	0.13	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	0	500	70	430 USD	98.14%	422'004.67	0.17	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	0	400	0	400 USD	94.92%	379'687.52	0.15	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	0	550	85	465 USD	97.33%	452'575.76	0.18	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	0	510	55	455 USD	99.14%	451'089.82	0.18	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	0	500	70	430 USD	99.08%	426'035.92	0.17	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	0	500	45	455 USD	99.33%	451'942.95	0.18	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	0	550	85	465 USD	97.84%	454'973.44	0.18	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	0	200	0	200 USD	98.75%	197'500.00	0.08	a)
US							106'320'164.82	42.14	

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

							15'455'531.96	6.13	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							15'455'531.96	6.13	
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	38'044	74'889	7'466	105'467 CNY	1'067.68	15'455'531.96	6.13	a)
CH							15'455'531.96	6.13	

Derivative Finanzinstrumente

							0.00	0.00
--	--	--	--	--	--	--	-------------	-------------

Devisentermingeschäfte

USD/CAD	Verfall 01.12.2022	90'000	66'307		CAD/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.12.2022	1'280'000	1'359'238		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/JPY	Verfall 28.12.2022	96'000'000	727'827		JPY/USD	0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.12.2022	100'000	121'126		GBP/USD	0.00	0.00	
USD/SGD	Verfall 28.12.2022	135'000	99'983		SGD/USD	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.01.2023	100'000	98'560		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.01.2023	180'000	167'004		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CNY	Verfall 04.01.2023	1'880'000	269'241		CNY/USD	0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 19.01.2023	63'534	85'000		USD/CAD	0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 23.02.2023	150'000	111'158		CAD/USD	0.00	0.00	
USD/JPY	Verfall 08.05.2023	101'937'975	750'000		JPY/USD	0.00	0.00	
CAD/USD	Verfall 13.06.2023	180'000	239'715		USD/CAD	0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 20.07.2023	250'328	190'000		CAD/USD	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

CAD/CHF	Verfall 04.10.2022	3'956'882	3'956'882		CHF/CAD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 04.10.2022	6'982	6'982		CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 02.11.2022	1'186'485	1'879'000		CHF/AUD	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall 02.11.2022	314'162	1'588'000		CHF/PLN	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	3'342'778	3'048'000		CHF/GBP	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall 02.11.2022	282'420	2'179'000		CHF/DKK	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 02.11.2022	171'510	1'904'000		CHF/NOK	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 02.11.2022	2'547'875	18'491'000		CHF/CNY	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		41'997'135	42'776'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2022		318'403	1'151'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		13'897'463	2'043'429'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2022		206'834	2'335'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		1'660'152	2'324'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		26'371'146	27'363'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2022		331'248	484'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		27'884	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		7'000	5'063		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		87'000	12'122		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		12'028'000	82'502		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		44'715	46'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		315'000	311'325		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		7'000	4'447		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.11.2022		6'000	1'191		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		87'817	629'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		1'798'000	12'281		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		5'000	4'867		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		29'000	28'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		9'000	6'477		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		12'000	13'275		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		19'937	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		630'000	4'285		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		8'000	7'748		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		121'000	118'392		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		153'000	153'329		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		20'000	22'563		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		39'000	5'428		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		4'228'000	28'598		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		3'000	1'877		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		4'000	2'889		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		235'000	32'152		CNY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		13'264	1'972'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		12'857	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		14'000	15'846		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		34'002	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		1'457	2'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		2'923	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		22'267	3'305'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		44'623	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		4'564	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		2'547	4'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2022		3'947	29'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		84'000	83'625		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.11.2022		18'788'000	2'564'938		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.11.2022		13'619'000	686'700		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2022		3'031'000	3'492'045		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2022		1'904'000	183'279		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2022		42'249'000	42'284'067		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2022		1'873'000	1'198'589		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2022		2'335'000	211'481		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.11.2022		1'582'000	331'777		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2022		2'179'000	289'524		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.11.2022		484'000	342'280		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2022		27'333'000	27'037'257		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2022		2'030'022'000	13'669'153		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2022		2'310'000	1'694'893		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2022		1'151'000	327'310		ILS/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2022		665'174	13'701'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.11.2022		54'000	2'644		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.11.2022		28'000	1'395		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		2'618'285	19'210'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.12.2022		675'285	13'507'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		3'550'141	3'089'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.12.2022		178'041	1'854'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		40'964'132	41'064'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		1'195'661	1'873'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		208'842	2'309'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.12.2022		300'287	1'441'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		288'039	2'170'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		341'925	485'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		26'620'977	26'943'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		13'186'708	1'958'263'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		1'606'974	2'197'000		CHF/CAD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		5'063	37'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		155'000	152'797	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.12.2022		11'000	2'295	PLN/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		92'565	81'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		69'000	68'757	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.12.2022		3'000	2'193	CAD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		49'929	7'399'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		2'549	4'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.12.2022		15'000	1'987	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		94'000	92'873	EUR/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		92'850	159'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		21'000	20'910	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		102'186	737'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.12.2022		3'000	2'208	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		3'053'000	20'700	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.12.2022		4'000	4'495	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		42'000	41'450	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		315'000	2'152	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		4'000	3'937	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		2'000	1'931	USD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		45'605	63'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		8'812	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.12.2022		2'000	2'246	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.12.2022		17'000	2'278	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		15'097	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		1'716'000	11'650	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.12.2022		2'000	1'269	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.12.2022		3'000	2'144	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.12.2022		30'000	3'998	CNY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		51'262	52'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		54'960	8'092'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.12.2022		4'000	4'495	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		89'000	84'891	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		7'155'000	48'217	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.12.2022		6'000	3'792	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.12.2022		8'000	5'684	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		37'117	39'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		40'709	36'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.12.2022		72'000	9'601	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.12.2022		49'000	2'395	MXN/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		1'959	2'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.12.2022		75'362	130'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		40'687	43'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		19'000	18'715	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		1'456'000	9'899	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.12.2022		2'000	2'289	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.12.2022		14'000	1'842	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.12.2022		479'000	43'223	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		25'225	36'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		59'354	52'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.12.2022		16'630	79'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		12'604'000	86'693	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		43'000	40'907	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.12.2022		178'838	1'345'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		63'192	99'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		172'000	169'479	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.12.2022		2'155'000	284'201	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.12.2022		40'938'000	39'000'404	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.12.2022		1'854'000	177'131	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.12.2022		2'279'000	1'601'499	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.12.2022		1'509'000	316'656	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.12.2022		1'947'455'000	13'295'665	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.12.2022		3'246'000	3'682'782	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.12.2022		289'000	171'004	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.12.2022		1'830'000	163'492	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.12.2022		13'458'000	661'785	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.12.2022		26'520'000	26'013'998	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.12.2022		1'968'000	1'255'604	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.12.2022		485'000	337'187	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.12.2022		1'142'000	315'269	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.12.2022		21'196'000	2'850'650	CNY/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2022		322'533	1'136'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2022		1'692	6'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.01.2023		13'426'110	1'966'965'000	CHF/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	NZD/CHF Verfall 02.01.2023		176'784	300'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.01.2023		92'451	13'383'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.01.2023		1'335'000	9'173	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.01.2023		13'725'000	94'135	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.01.2023		2'573'000	18'138	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.01.2023		5'000	2'915	NZD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.01.2023		32'991	4'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.01.2023		22'794	3'296'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.01.2023		14'950'000	103'639	JPY/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		298'600	2'268'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		40'453'412	42'660'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2023		180'804	1'899'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		1'654'599	2'364'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2023		335'143	1'618'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		3'869'546	3'422'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		167'518	1'879'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2023		682'077	14'014'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		27'171'388	27'747'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		1'284'130	2'019'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		346'058	500'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2023		317'306	1'153'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2023		2'867'809	21'366'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2023		25'000	28'720	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		355'334	380'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.01.2023		4'567	94'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.01.2023		2'285	11'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		68'826	70'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2023		3'454	26'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		7'652	12'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		6'967	10'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2023		14'000	1'883	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2023		18'000	17'735	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		34'613	37'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		21'698	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2023		217'000	214'030	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2023		14'000	15'982	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2023		10'000	6'319	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2023		12'000	8'248	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2023		2'000	1'380	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.01.2023		8'000	1'672	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2023		5'000	1'362	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2023		72'000	3'404	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2023		95'000	12'762	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2023		385'000	359'332	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2023		11'000	1'459	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2023		5'000	3'083	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2023		28'000	27'575	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		53'599	58'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2023		2'000	1'359	CAD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		12'345	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2023		43'000	5'685	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2023		36'000	3'387	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2023		41'744	315'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2023		270'000	12'649	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2023		43'000	29'224	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2023		22'000	5'872	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2023		34'000	21'133	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2023		22'000	20'353	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2023		33'000	36'984	GBP/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		30'822	45'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2023		36'000	3'204	SEK/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		39'311	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.01.2023		31'000	6'524	PLN/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		102'488	104'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		1'880	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		23'445	21'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		2'048	3'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2023		7'687	58'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		134'506	145'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		1'590	12'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2023		92'000	84'959	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.01.2023		203'597	1'540'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2023		1'863'000	174'954	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2023		1'843'000	163'677	SEK/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 04.01.2023		2'226'000	295'591	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2023		543'000	374'545	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2023		1'955'761'000	13'715'537	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2023		1'985'000	1'245'528	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.01.2023		23'196'000	3'101'537	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2023		2'320'000	1'584'282	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.01.2023		13'766'000	653'519	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2023		3'401'000	3'785'279	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.01.2023		295'000	172'653	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2023		27'698'000	27'352'606	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2023		1'126'000	295'248	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2023		42'781'000	39'577'987	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.01.2023		1'590'000	335'355	PLN/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2023		176'096	1'879'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		159'439	1'798'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		283'636	2'138'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		380'419	553'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		13'481'841	1'921'366'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		1'213'508	1'938'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		3'130'614	23'438'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		1'563'151	2'296'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.02.2023		661'348	14'049'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		3'607'560	3'249'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2023		169'251	290'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		26'479'546	26'843'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.02.2023		293'745	1'123'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		39'467'016	42'801'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.02.2023		335'890	1'602'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		151'477'000	1'087'662	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		2'258'000	2'234'433	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2023		92'000	58'114	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2023		184'000	48'799	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.02.2023		1'448'000	196'190	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2023		12'000	7'022	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2023		108'000	74'110	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2023		151'000	169'762	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2023		24'000	16'720	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2023		91'000	8'490	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		3'539'000	3'311'290	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.02.2023		1'508'000	72'267	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2023		88'000	7'818	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.02.2023		71'000	14'963	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2023		427'000	56'824	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		143'000	142'131	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		3'663	27'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		17'908'000	128'693	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		181'000	166'395	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2023		30'000	20'618	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2023		21'000	23'715	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2023		12'000	7'717	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		113'000	104'182	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		1'946	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		44'098	44'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		2'067	3'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		5'704	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		22'375	3'167'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		5'308	39'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.02.2023		238'591	1'744'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		33'666'000	238'427	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2023		1'788'000	164'442	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2023		2'161'000	1'487'805	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2023		278'000	165'046	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2023		939'000	249'661	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2023		1'721'482'000	12'162'959	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2023		24'486'000	24'430'172	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2023		1'711'000	229'479	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2023		529'000	369'808	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		38'968'000	35'799'122	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.02.2023		12'541'000	612'826	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2023		1'837'000	1'189'182	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.02.2023		1'531'000	324'055	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2023		1'710'000	150'035	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2023		3'082'000	3'485'619	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.02.2023		23'800'000	3'236'562	CNY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	NOK/CHF Verfall 02.03.2023		165'431	1'802'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		1'513'755	2'205'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		168'145	284'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.03.2023		249'592	941'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		11'818'321	1'671'502'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		24'685'248	24'772'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		233'518	1'743'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		367'482	527'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		36'482'447	39'834'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.03.2023		618'811	12'768'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		1'223'713	1'894'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.03.2023		335'022	1'591'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		152'615	1'742'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		3'573'104	3'167'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		3'219'109	23'706'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		294'242	295'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.03.2023		4'015	83'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.03.2023		3'434	13'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		64'088	57'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		97'180	13'728'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		4'790	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		14'622	108'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		3'874	6'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		462'223	507'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		13'000	13'011		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		909'000	6'405		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		25'769	28'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		12'000	1'631		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		50'000	46'260		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		37'783	34'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		18'000	17'784		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		18'000	2'425		CNY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		32'207	4'667'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.03.2023		39'535	294'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		863'000	5'932		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		41'127	60'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		12'000	11'866		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		64'000	59'212		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.03.2023		1'802'000	163'261		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		1'688'125'000	11'614'469		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.03.2023		284'000	164'924		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		2'272'000	1'564'227		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.03.2023		1'742'000	156'571		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.03.2023		527'000	366'950		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.03.2023		24'078'000	3'246'437		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.03.2023		1'743'000	232'795		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		1'900'000	1'200'971		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.03.2023		12'851'000	657'330		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		3'258'000	3'697'146		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.03.2023		1'591'000	336'094		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.03.2023		954'000	244'787		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		40'255'000	37'731'817		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		25'024'000	24'874'607		EUR/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		159'868	1'768'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		11'691'037	1'697'623'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		159'125	275'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		1'511'635	2'203'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		149'897	1'671'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		322'843	465'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		3'228'034	23'981'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		226'331	1'697'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		1'165'896	1'849'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.04.2023		629'431	12'429'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		3'403'044	3'008'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.04.2023		327'780	1'561'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.04.2023		233'620	913'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		36'317'581	38'888'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		24'231'715	24'418'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.04.2023		2'001	39'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		6'338	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		60'058	60'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		253'152	1'855'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.04.2023		1'920	9'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		2'094	3'000		CHF/SGD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		191'893	205'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		102'656	14'862'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		11'013	16'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		33'743	30'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2023		11'000	7'421	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		8'474'000	59'278	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		7'000	7'872	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		58'000	57'222	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2023		9'000	5'559	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.04.2023		143'000	19'254	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		23'000	21'347	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		102'000	101'651	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		20'424'000	140'518	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		20'000	18'262	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.04.2023		172'821	1'302'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		90'428	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		3'111'000	3'513'750	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.04.2023		12'468'000	630'772	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		24'318'000	24'133'670	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2023		1'850'000	1'131'830	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2023		468'000	321'544	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2023		1'671'000	147'198	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.04.2023		275'000	157'168	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.04.2023		1'768'000	154'205	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2023		2'208'000	1'490'334	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.04.2023		1'570'000	332'903	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2023		1'697'000	226'091	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.04.2023		913'000	231'628	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		1'683'587'000	11'555'468	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		39'050'000	35'671'394	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.04.2023		26'995'000	3'590'875	CNY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		3'644'567	3'235'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		643'075	12'825'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		24'657'929	24'884'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		1'178'877	1'931'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		333'143	486'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.05.2023		161'806	284'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		151'450	1'722'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		157'403	1'808'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		1'529'970	2'273'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.05.2023		337'723	1'601'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		230'588	1'733'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		233'294	922'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		11'861'695	1'726'161'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		36'502'352	40'086'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		445'019	489'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		1'465	11'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		5'413	8'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		1'074'000	7'417	JPY/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		1'371	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		3'006	60'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		3'038	12'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		4'324	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		252'074	254'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		10'000	9'841	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		722'000	4'865	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		21'488	24'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		60'000	53'795	USD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		1'340	2'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		12'579	1'876'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		3'343	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		26'554	27'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		75'801	574'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.05.2023		103'780	488'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		328'318	544'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		421'524	631'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		21'986	253'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		3'079'250	461'116'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		205'940	4'153'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		84'781	126'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		22'617	266'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		1'004'619	899'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		6'692'590	6'802'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.05.2023		64'688	116'000	CHF/NZD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		75'282	306'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		9'858'474	10'986'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		2'187'000	14'590	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		4'000	4'450	GBP/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		55'905	57'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		2'000	1'209	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		49'996	56'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		2'000	1'328	CAD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		136'872	20'525'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		17'693	16'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		5'324	9'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.05.2023		3'250	66'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		1'332	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		7'204	11'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		370'076	415'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.05.2023		1'702	8'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		232'090	237'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		3'000	3'355	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		52'008	58'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		2'000	1'318	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		27'000	26'663	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		1'912'000	12'789	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.05.2023		17'104'000	843'850	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.05.2023		2'074'000	172'640	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		1'975'000	171'371	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		52'054'000	46'327'019	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		2'489'000	1'463'880	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		2'203'783'000	14'403'926	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		2'921'000	1'916'702	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		400'000	219'880	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.05.2023		36'148'000	4'646'825	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.05.2023		1'240'000	303'502	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.05.2023		616'000	410'921	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		32'224'000	31'667'492	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.05.2023		2'097'000	449'762	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		4'146'000	4'638'503	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2023		2'318'000	305'605	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		3'621'328	27'252'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		157'535	1'189'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.05.2023		11'000	1'434	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		3'912	30'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		991'267	7'614'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.05.2023		36'000	4'678	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		18'119	141'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.05.2023		31'000	4'007	CNY/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.06.2023		842'626	17'247'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		173'461	2'088'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		1'468'948	2'503'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		1'922'319	2'938'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		46'451'911	52'375'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		171'643	1'982'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		14'432'805	2'206'301'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		4'702'686	36'621'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		31'534'389	32'144'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		4'547'491	4'076'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		225'681	412'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.06.2023		454'117	2'128'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		303'837	2'308'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		3'530	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		336'281	51'258'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 02.06.2023		216'410	1'683'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		417'513	425'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		400'733	451'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		8'947	8'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		3'933	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.06.2023		1'766	36'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		143'706	21'910'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		70'031	63'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		17'674	27'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 02.06.2023		2'350	11'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		312'737	319'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		1'470	17'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		3'683	28'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.06.2023		2'999	61'000	CHF/MXN		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		272'776	306'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		40'671	6'188'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		73'000	71'502	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		21'000	2'694	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		20'348	23'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		15'000	16'643	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		10'000	1'315	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		1'948	3'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		10'044	17'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		489'000	3'239	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		11'000	1'418	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		11'572	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		7'000	6'869	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		13'000	12'655	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		939'000	6'230	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		15'000	1'929	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		24'170	27'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		14'368	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		10'000	1'282	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		8'000	7'779	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		601'000	3'934	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		17'000	15'321	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		6'808	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		3'838	589'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		40'724	42'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		49'218	7'575'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		18'000	2'294	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		94'000	84'539	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		2'000	2'235	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		61'000	7'809	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.06.2023		36'000	1'822	MXN/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		11'678	12'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		3'691'000	24'031	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		6'000	3'992	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		38'867	43'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		6'000	6'708	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		5'000	2'956	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		4'124'000	4'672'863	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.06.2023		412'000	225'751	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.06.2023		2'088'000	171'320	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		53'143'000	48'584'393	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		2'968'000	1'996'188	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.06.2023		38'168'000	4'896'191	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.06.2023		17'308'000	890'973	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.06.2023		2'139'000	459'772	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		32'848'000	32'014'646	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		632'000	426'461	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		2'521'000	1'491'524	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		2'326'000	304'427	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		1'999'000	167'916	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		2'288'101'000	14'972'189	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		1'242'000	303'943	ILS/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		303'085	1'242'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		419'128	630'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		1'330	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2023		2'708	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.07.2023		17'488'000	912'183	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.07.2023		622'000	411'148	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.07.2023		1'240'000	298'914	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.07.2023		405'000	222'001	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.07.2023		4'013'000	4'564'025	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.07.2023		2'036'000	448'286	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.07.2023		2'071'000	172'970	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.07.2023		2'457'000	1'463'315	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.07.2023		52'038'000	46'559'439	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2023		32'585'000	31'804'589	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.07.2023		41'378'000	5'088'253	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.07.2023		1'980'000	164'023	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.07.2023		2'236'734'000	13'844'041	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.07.2023		2'337'000	306'381	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.07.2023		2'862'000	1'935'141	CAD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		4'407'547	3'902'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.07.2023		221'030	405'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		169'540	2'071'000	CHF/NOK		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		47'257'762	51'893'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		1'928'493	2'876'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		882'076	17'325'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		4'900'661	38'241'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.07.2023		453'725	2'123'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		31'391'352	32'270'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		418'645	622'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		1'441'609	2'443'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		302'891	2'318'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		165'979	1'980'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		14'714'927	2'245'964'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.07.2023		302'740	1'240'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		223'000	201'995		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		58'997	52'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.07.2023		5'000	3'356		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.07.2023		4'000	2'378		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		179'000	174'298		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.07.2023		34'000	1'743		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		15'378'000	100'719		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		391'178	3'064'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		124'770	138'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		20'862	31'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		164'166	169'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		5'986	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		35'008	31'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		11'000	10'677		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		816'000	5'307		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.07.2023		15'000	1'907		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		19'910	22'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		13'504	107'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		45'550	47'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		37'709	5'821'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.07.2023		91'000	55'275		AUD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		2'326	45'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.07.2023		105'000	70'993		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		45'890	51'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.07.2023		100'000	21'794		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		9'000	10'195		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		14'514	16'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		7'000	6'834		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		556'000	3'625		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.07.2023		20'000	2'510		CNY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		28'671	32'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		1'110'000	7'155		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		16'000	15'580		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		1'210'000	7'710		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.07.2023		22'000	2'756		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		51'675	53'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		38'000	33'933		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.07.2023		2'000	1'349		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		4'000	4'554		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.07.2023		12'000	1'503		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		11'000	9'818		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		9'000	8'784		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		679'000	4'293		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.07.2023		409'000	51'150		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		41'385	61'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		11'000	9'835		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		5'000	4'900		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		378'000	2'384		JPY/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		2'342	45'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		229'850	257'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		11'366	10'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		59'135	99'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		13'214	107'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		4'758	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		36'506	5'854'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		125'884	129'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		5'339	102'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.07.2023		2'870	13'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		131'408	134'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		65'000	58'206		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		1'466'000	9'123		JPY/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		2'502	19'000		CHF/DKK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		40'348	325'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		34'234	30'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		2'039	3'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		32'000	36'200	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.07.2023		20'000	2'627	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.07.2023		4'000	2'705	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.07.2023		14'000	3'051	PLN/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		73'539	82'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.07.2023		113'000	5'921	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		131'000	128'123	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.07.2023		1'482	12'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		2'623	20'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		37'343	33'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.07.2023		3'076	14'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		4'267	688'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		6'174	118'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		137'693	141'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		105'000	94'179	USD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		914'896	17'693'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		411'668	624'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		303'490	1'262'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		220'221	403'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		4'586'798	4'044'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.08.2023		450'677	2'056'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		170'634	2'047'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		46'250'261	51'846'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		1'441'178	2'425'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		31'756'719	32'586'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		162'425	1'964'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		5'384'436	43'824'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		13'918'063	2'245'595'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		304'293	2'324'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		1'909'269	2'831'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		3'072	59'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.08.2023		2'630	12'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		469'182	525'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		987'000	6'133	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		17'563	26'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		110'027	97'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		10'000	5'978	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		68'462	554'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		294'776	302'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.08.2023		2'000	1'325	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		64'000	62'395	EUR/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		69'691	11'202'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		7'000	4'183	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		13'000	14'805	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.08.2023		145'000	17'916	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		9'000	6'076	CAD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		28'480	544'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.08.2023		6'000	1'308	PLN/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		15'219	17'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		1'104'000	6'870	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		27'733	31'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.08.2023		19'000	2'345	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		2'000	2'272	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		15'000	14'601	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.08.2023		132'000	16'122	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		6'740'000	42'330	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		12'000	13'627	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		186'609	212'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		98'000	94'914	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.08.2023		6'000	1'305	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		8'000	5'310	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		7'000	4'104	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.08.2023		54'000	2'772	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		684'000	4'255	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		227'000	194'703	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		207'556	216'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		40'000	38'523	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		5'000	5'603	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.08.2023		53'000	6'327	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		72'806	112'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		2'748'000	17'014	JPY/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		13'458	14'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		6'142	997'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		33'000	28'330	USD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		2'138	18'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		31'835	133'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		9'661'939	11'175'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		190'508	3'714'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		390'424	595'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		6'723'743	6'973'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		31'835	246'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		2'977'620	482'569'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		18'691	217'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		312'797	533'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		22'628	42'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		51'777	618'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		1'173'083	9'734'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		1'006'125	905'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		82'802	127'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.08.2023		117'644	543'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		55'000	47'582	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		715'749	824'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		248'780	40'434'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		487'999	511'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		30'134	27'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.08.2023		3'023	14'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		2'613	4'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		12'507	19'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		82'288	679'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		6'318	122'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		9'351	16'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		3'232	62'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		2'698	21'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		1'606	3'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		16'740	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		1'303	2'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		244'159	255'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		6'555	10'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		2'577	11'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		1'734	21'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		4'629	8'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		101'924	16'481'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		1'536	18'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		360'018	415'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.08.2023		18'676	154'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.08.2023		1'519	7'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		64'730'000	56'108'611	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.08.2023		54'614'000	6'626'863	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.08.2023		448'000	241'687	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		40'640'000	38'839'648	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.08.2023		2'282'000	195'545	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.08.2023		2'591'000	332'270	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.08.2023		755'000	492'872	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.08.2023		2'620'000	568'527	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		3'576'000	2'355'189	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		2'785'015'000	16'990'820	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		2'958'000	1'727'768	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		2'603'000	214'721	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.08.2023		22'140'000	1'148'995	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		5'056'000	5'638'653	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.08.2023		1'406'000	332'660	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.09.2023		2'727'000	584'410	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2023		41'046'000	39'348'748	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.09.2023		23'914'000	1'254'957	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2023		5'308'000	5'941'032	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.09.2023		2'908'000	374'056	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.09.2023		1'442'000	335'337	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2023		3'044'000	1'741'290	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2023		3'685'000	2'405'826	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2023		2'689'000	216'922	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2023		2'772'771'000	16'822'956	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2023		509'000	267'714	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.09.2023		771'000	504'273	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.09.2023		2'332'000	193'626	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		65'756'000	58'081'617	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	CHF/CNY Verfall 04.09.2023		60'074'000	7'289'379	CNY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		56'538'235	65'458'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2023		7'233'634	59'649'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		240'838	448'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		39'000'119	40'888'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		195'581	2'288'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		333'129	2'602'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		494'477	759'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.09.2023		577'399	2'675'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		17'063'058	2'792'544'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		2'345'189	3'572'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		1'743'946	2'993'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		217'173	2'638'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		1'149'887	22'371'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		333'907	1'415'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		5'826'252	5'242'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		96'543	87'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2023		45'754	376'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		32'250	251'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		178'418	204'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2023		15'184'000	93'085	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.09.2023		2'000	1'305	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		28'193	43'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		55'305	1'085'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		44'985	47'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		27'650	52'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.09.2023		7'000	4'009	AUD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		33'139	58'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		6'405	27'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		23'425	460'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2023		6'421	53'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		7'098	55'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		45'573	70'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		9'104	14'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.09.2023		11'157	52'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2023		92'000	80'444	USD/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		3'770	44'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2023		3'957'000	24'167	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2023		21'000	23'382	GBP/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		4'761	9'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		4'178	51'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		42'000	40'385	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2023		3'364'000	20'361	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2023		6'000	6'667	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.09.2023		72'000	8'690	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.09.2023		3'000	1'708	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		92'131	105'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		49'000	46'933	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.09.2023		29'000	1'486	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.09.2023		4'000	2'607	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.09.2023		8'204	68'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		1'389	27'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		6'720	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		19'265	3'173'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		199'152	208'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		2'596	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		62'473	71'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		1'693	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2023		441'000	2'663	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		6'000	5'726	EUR/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		8'789	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.10.2023		584'270	2'739'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		38'936'562	40'685'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2023		1'222'447	23'482'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		5'823'278	5'218'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		371'980	2'896'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		306'781	1'322'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		1'737'774	3'044'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		2'388'996	3'669'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		212'210	2'635'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		16'597'296	2'731'692'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.10.2023		263'767	503'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		489'645	750'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		192'458	2'323'000	CHF/NOK		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		56'682'935	64'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		172'657	181'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		4'557	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		1'948	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		1'920	15'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		31'732	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		31'149	28'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		2'992'000	18'143		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		13'000	12'361		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		20'394	23'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		873'000	5'264		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.10.2023		40'000	20'913		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.10.2023		3'785'000	190'965		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		60'000	39'211		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		234'000	29'974		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		441'549'000	2'674'498		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		6'358'000	6'071'286		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		212'000	16'985		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		610'000	397'722		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		815'000	906'806		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.10.2023		106'000	24'702		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.10.2023		220'000	45'874		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		440'000	250'096		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		10'501'000	9'352'506		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.10.2023		187'000	15'518		NOK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		145'205	163'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		3'000	1'958		CAD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		68'506	77'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		2'390'000	14'451		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		4'000	4'444		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		36'000	34'359		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		51'721	54'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		49'703	8'168'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		96'834	108'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		1'556'000	9'465		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		3'343	5'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2023		1'780	34'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		22'054	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		48'000	43'039		USD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		7'783	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		2'320	4'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		3'933'000	23'839		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		1'333	2'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		3'323	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		8'041	9'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		3'332	544'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		6'733	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		12'628	14'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		19'313	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		2'646'000	16'233		JPY/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		2'227	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		1'270	15'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		11'134	19'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		2'463	19'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.10.2023		3'773	18'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		1'411	17'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		107'307	111'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		278'000	253'880		USD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.10.2023		1'633	3'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		1'909	8'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2023		7'541	144'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		14'892	22'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		3'338	5'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		33'337	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		6'432'000	39'498		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		2'696'000	350'183		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		2'635'000	1'555'920		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		2'278'033'000	13'965'709		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		4'469'000	4'990'130		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.10.2023		55'380'000	6'954'067		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.10.2023		19'875'000	1'046'268		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		53'973'000	49'377'199		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.10.2023		1'224'000	294'139		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.10.2023		2'151'000	184'943		NOK/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		3'088'000	2'089'526		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/NZD Verfall 03.10.2023		466'000	256'151		NZD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		2'440'000	205'472		SEK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		34'674'000	33'585'236		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/PLN Verfall 03.10.2023		2'537'000	531'715		PLN/CHF	0.00	0.00		
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		695'000	465'838		SGD/CHF	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		7'295'806	60'273'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		254'856	2'100'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		22'000	2'672		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		7'886'000	960'665		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		56'000	6'771		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		11'662	95'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		3'674	30'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		2'096	17'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		3'864	31'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		99'587	798'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		334'175	2'577'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		1'463'021	2'483'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		13'518'184	2'201'569'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		4'721'285	4'241'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)	
	CNY/CHF Verfall 02.11.2023		6'829'117	54'493'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		47'268'202	51'834'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2023		285'615	1'191'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)	
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		181'845	2'120'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		1'974'395	2'926'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		249'311	455'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		200'527	2'386'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		31'424'354	32'507'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)	
	PLN/CHF Verfall 02.11.2023		475'294	2'277'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		441'549	660'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		924'450	17'712'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte auf Klassen								0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	924'979.87	0.37
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	234'146'395.75	92.80
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	15'455'531.96	6.13
Sonstige Vermögenswerte	1'776'769.73	0.70
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	252'303'677.31	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-9'145.68	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	252'294'531.63	

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);	249'601'927.71	98.93
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	0.64540000
CAD	1 = USD	0.73964497
CHF	1 = USD	1.09313511
CNY	1 = USD	0.13725423
DKK	1 = USD	0.14198092
EUR	1 = USD	1.05875004
GBP	1 = USD	1.22055000
ILS	1 = USD	0.26267402
JPY	1 = USD	0.00670129
MXN	1 = USD	0.05754237
MYR	1 = USD	0.21298120
NOK	1 = USD	0.09397745
NZD	1 = USD	0.60085000
PLN	1 = USD	0.22909245
SEK	1 = USD	0.09204543
SGD	1 = USD	0.73265441

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	120'563'317.77	47.787
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	68'987'971.37	27.344

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

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	-	0.109	0.00 - 0.01	-	0.008
FA USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.109	0.00 - 0.01	-	0.008
GT USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.109	0.00 - 0.01	-	0.008
NT USD	USD	0.00 - 0.12	-	0.109	0.00 - 0.01	-	0.008
NTH1 CHF	USD	0.00 - 0.12	-	0.109	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: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
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 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DA USD	Ja	USD	1.35000	0.47250	0.87750
FA USD	Ja	USD	1.35000	0.47250	0.87750

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT USD	Ja	USD	1.637	0.572	1.065
NT USD	Ja	USD	1.707	0.597	1.110
NTH1 CHF	Ja	USD	1.857	0.649	1.208

12 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.
- 14) Neue Klassenbezeichnung per 14.09.2022: von NTH CHF Klasse in NTH1 CHF Klasse.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

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

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

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