

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD REST GOVT.

## Jahresbericht per 31.01.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Index Fund II  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA CHF	21580450	CHF
NT CHF	21580458	CHF
ST CHF	30246910	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund II,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen 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 entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen 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 Jahresrechnungen“ 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 Jahresrechnungen**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen 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 von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, 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 Jahresrechnungen 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 den Jahresrechnungen 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**

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen 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	10
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	10
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	11
7	Pauschale Verwaltungskommission	11
8	Benchmark	11
9	TER	11
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	12
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	12
12	Fussnoten	12
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	13
14	Pflichtpublikationen	15

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		107'426'796.35	94'375'339.45	74'857'036.85	83'930'047.84
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		265'732.47	339'204.09	294'695.44	267'611.49
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'586.283	4'336.283	3'422.283	2'907.283
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		74.0969	78.2246	86.1108	92.0487
Ausschüttung je Anteil		2.75	2.70	2.60	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.29 %	0.29 %	0.29 %	0.29 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		67'949'560.24	57'853'077.50	37'165'057.44	36'092'891.25
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		846'982.617	700'809.798	418'336.430	385'657.253
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		80.2254	82.5518	88.8401	93.5880
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		93.5192	89.8522	95.4193	105.2023
Thesaurierung je Anteil		3.18	2.96	2.93	2.18
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse ST CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		39'211'503.64	36'183'057.86	37'397'283.97	47'569'545.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		448.269	401.991	386.072	466.172
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		87'473.1548	90'009.6218	96'866.0871	102'042.9050
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		101'967.8905	97'969.6563	104'039.6188	114'706.5029
Thesaurierung je Anteil		3'469.89	3'230.13	3'203.25	2'382.90
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

### Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA CHF	-1.85 %	1.55 %	-9.07 %	-5.17 %
Klasse NT CHF	-1.57 %	1.84 %	-8.80 %	-4.89 %
Klasse ST CHF	-1.57 %	1.84 %	-8.80 %	-4.89 %
Benchmark	-1.55 %	1.88 %	-8.85 %	-4.84 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	0.10 %	0.10 %	0.09 %	0.07 %

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

## Tracking Differenz

### Klasse

Klasse FA CHF	-0.30 %
Klasse NT CHF	-0.02 %
Klasse ST CHF	-0.02 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	8'896'131.67	288'019.23
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	98'844'250.34	93'040'772.14
Sonstige Vermögenswerte	1'130'052.95	1'046'634.22
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>108'870'434.96</b>	<b>94'375'425.59</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'443'569.07	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-69.54	-86.14
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>107'426'796.35</b>	<b>94'375'339.45</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'336.283	3'422.283
Ausgegebene Anteile		-	1'664.000
Zurückgenommene Anteile		-750.000	-750.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>3'586.283</b>	<b>4'336.283</b>

Klasse NT CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		700'809.798	418'336.430
Ausgegebene Anteile		162'620.029	302'864.051
Zurückgenommene Anteile		-16'447.210	-20'390.683
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>846'982.617</b>	<b>700'809.798</b>

Klasse ST CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		401.991	386.072
Ausgegebene Anteile		82.925	88.102
Zurückgenommene Anteile		-36.647	-72.183
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>448.269</b>	<b>401.991</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		94'375'339.45	74'857'036.85
Ausbezahlte Ausschüttung		-11'491.96	-8'637.94
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'259'928.79	-803'292.13
Saldo aus dem Anteilverkehr		15'475'779.20	22'713'104.70
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-1'152'901.55	-2'382'872.03
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>107'426'796.35</b>	<b>94'375'339.45</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.02.2023 31.01.2024</b>	<b>01.02.2022 31.01.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		2'052.75	248.25
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-368.69
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		4'050'888.10	2'608'724.31
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		335'990.17	874'627.57
<b>Total Ertrag</b>		<b>4'388'931.02</b>	<b>3'483'231.44</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-40.42	-14.10
Reglementarische Vergütungen		-904.11	-911.00
Sonstige Aufwendungen		0.00	-5.65
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-127'290.43	-96'281.25
<b>Total Aufwand</b>		<b>-128'234.96</b>	<b>-97'212.00</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>4'260'696.06</b>	<b>3'386'019.44</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'023'319.22	-2'797'335.70
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		61'195.75	96'728.60
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>1'298'572.59</b>	<b>685'412.34</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'451'474.14	-3'068'284.37
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-1'152'901.55</b>	<b>-2'382'872.03</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse FA CHF</b>	<b>31.01.2024</b>	<b>31.01.2023</b>
Nettoertrag	9'823.47	11'390.07
Vortrag des Vorjahres	144.37	462.26
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>9'967.84</b>	<b>11'852.33</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	9'862.28	11'707.96
Vortrag auf neue Rechnung	105.56	144.37
<b>Total</b>	<b>9'967.84</b>	<b>11'852.33</b>
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>31.01.2024</b>	<b>31.01.2023</b>
Nettoertrag	2'695'427.64	2'076'145.35
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>2'695'427.64</b>	<b>2'076'145.35</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	943'399.67	726'650.87
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'752'027.97	1'349'494.48
<b>Total</b>	<b>2'695'427.64</b>	<b>2'076'145.35</b>
<b>Klasse ST CHF</b>	<b>31.01.2024</b>	<b>31.01.2023</b>
Nettoertrag	1'555'444.95	1'298'484.02
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>1'555'444.95</b>	<b>1'298'484.02</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	544'405.73	454'469.41
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'011'039.22	844'014.61
<b>Total</b>	<b>1'555'444.95</b>	<b>1'298'484.02</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>98'844'250.34</b>	<b>90.79</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>98'844'250.34</b>	<b>90.79</b>	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	14'910	1'750	2'245	14'415 DKK	125.95%	2'269'846.42	2.08	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	6'105	2'550	0	8'655 DKK	98.59%	1'066'776.03	0.98	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	9'500	1'050	1'000	9'550 DKK	93.90%	1'121'094.64	1.03	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	8'710	320	1'300	7'730 DKK	91.01%	879'541.30	0.81	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	8'190	1'100	855	8'435 DKK	54.76%	577'470.45	0.53	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	11'280	0	2'055	9'225 DKK	84.31%	972'306.80	0.89	a)
DK0009924292	0.0000 % DGB 0 11/15/24	8'350	700	9'050	0 DKK	0.00%	0.00	0.00	
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	0	5'390	0	5'390 DKK	98.95%	666'772.80	0.61	a)
<b>DKK</b>							<b>7'553'808.44</b>	<b>6.94</b>	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	1'988	200	200	1'988 ILS	106.53%	499'435.99	0.46	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	2'762	180	300	2'642 ILS	111.25%	693'115.11	0.64	a)
IL0011308488	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/24 0324	2'668	0	2'668	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	2'528	1'280	520	3'288 ILS	96.88%	751'142.81	0.69	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	2'560	1'400	340	3'620 ILS	95.02%	811'168.66	0.75	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	3'264	590	365	3'489 ILS	87.01%	715'852.43	0.66	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	3'258	943	450	3'751 ILS	93.52%	827'106.17	0.76	a)
IL0011550683	1.5000 % ILGOV 1 1/2 11/30/23 1123	1'188	0	1'188	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	3'167	2'564	0	5'731 ILS	84.07%	1'136'121.36	1.04	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	2'850	660	400	3'110 ILS	96.17%	705'311.89	0.65	a)
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	2'210	1'720	0	3'930 ILS	70.36%	652'094.23	0.60	a)
IL0011746976	0.5000 % ILGOV 0 1/2 02/27/26 0226	2'000	2'052	0	4'052 ILS	93.64%	894'704.64	0.82	a)
IL0011757775	0.4000 % ILGOV 0.4 10/31/24 1024	2'110	450	2'560	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011806606	1.3000 % ILGOV 1.3 04/30/32 0432	1'230	2'082	0	3'312 ILS	80.38%	627'746.60	0.58	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	850	880	0	1'730 ILS	69.72%	284'448.27	0.26	a)
IL0011948028	3.7500 % ILGOV 3 3/4 02/28/29 0229	0	1'949	0	1'949 ILS	99.64%	457'895.17	0.42	a)
<b>ILS</b>							<b>9'056'143.33</b>	<b>8.32</b>	
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M	325'000	19'000	344'000	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	99'330	9'000	7'100	101'230 MXN	106.28%	537'361.66	0.49	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	457'370	86'000	56'700	486'670 MXN	94.72%	2'302'314.37	2.11	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	377'410	59'000	39'000	397'410 MXN	97.46%	1'934'520.24	1.78	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	299'790	25'400	30'150	295'040 MXN	93.92%	1'384'008.59	1.27	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	556'642	93'300	64'000	585'942 MXN	92.73%	2'713'778.71	2.49	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	368'226	118'800	42'250	444'776 MXN	86.50%	1'921'608.70	1.77	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	111'290	36'000	0	147'290 MXN	90.35%	664'685.25	0.61	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	592'600	94'800	76'150	611'250 MXN	92.38%	2'820'283.65	2.59	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	341'400	59'300	41'250	359'450 MXN	88.04%	1'580'558.00	1.45	a)
MX0MGO000151	8.0000 % MBONO 8 09/05/24 M	413'700	33'000	446'700	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO000193	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	0	202'000	0	202'000 MXN	93.95%	947'901.81	0.87	a)
MX0MGO0001B0	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	201'400	168'000	174'900	194'500 MXN	94.84%	921'363.17	0.85	a)
MX0MGO0001C8	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	251'600	302'300	51'950	501'950 MXN	89.64%	2'247'320.74	2.06	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	135'000	288'500	36'600	386'900 MXN	89.75%	1'734'332.68	1.59	a)
MX0MGO0001E4	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	117'500	183'800	6'050	295'250 MXN	87.15%	1'285'177.80	1.18	a)
MX0MGO0001F1	8.5000 % MBONO 8 1/2 03/01/29 M	0	125'770	4'500	121'270 MXN	97.38%	589'827.22	0.54	a)
MXM5GO000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	0	35'000	3'200	31'800 MXN	91.26%	144'940.85	0.13	a)
<b>MXN</b>							<b>23'729'983.44</b>	<b>21.80</b>	
MYBMI1900030	3.4780 % MGS 3.478 06/14/24 0319	2'700	0	2'700	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBMI2300024	3.5190 % MGS 3.519 04/20/28 0223	0	2'291	0	2'291 MYR	99.89%	415'051.20	0.38	a)
MYBMK1800012	3.8820 % MGS 3.882 03/14/25 0118	2'000	500	0	2'500 MYR	100.63%	456'251.98	0.42	a)
MYBMK2200030	4.5040 % MGS 4.504 04/30/29 0322	1'200	400	0	1'600 MYR	104.19%	302'340.44	0.28	a)
MYBML1700020	4.0590 % MGS 4.059 09/30/24 0217	1'800	0	1'800	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBML1900018	3.9060 % MGS 3.906 07/15/26 0119	1'200	1'670	0	2'870 MYR	101.17%	526'608.86	0.48	a)
MYBMO1400013	4.1810 % MGS 4.181 07/15/24 0114	1'470	0	1'470	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	3'700	600	0	4'300 MYR	100.99%	787'545.31	0.72	a)
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	3'300	0	0	3'300 MYR	101.31%	606'364.30	0.56	a)
MYBMO1700040	3.8990 % MGS 3.899 11/16/27 0417	3'150	400	0	3'550 MYR	101.42%	652'957.71	0.60	a)
MYBMO1900020	3.8850 % MGS 3.885 08/15/29 0219	3'000	0	0	3'000 MYR	101.29%	551'120.57	0.51	a)
MYBMO2000028	2.6320 % MGS 2.632 04/15/31 0220	2'700	0	0	2'700 MYR	92.78%	454'326.80	0.42	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	2'000	900	0	2'900 MYR	98.34%	517'234.23	0.48	a)
MYBMS1100036	4.3920 % MGS 4.392 04/15/26 0311	1'750	0	0	1'750 MYR	102.10%	324'064.18	0.30	a)
MYBMS1200026	3.8920 % MGS 3.892 03/15/27 0212	1'000	0	0	1'000 MYR	101.25%	183'621.62	0.17	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	3'150	600	0	3'750 MYR	100.66%	684'595.60	0.63	a)
MYBMS1900047	3.8280 % MGS 3.828 07/05/34 0419	2'300	600	0	2'900 MYR	100.15%	526'764.53	0.48	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	1'180	1'875	0	3'055 MYR	106.80%	591'759.02	0.54	a)
MYBMX0700034	3.5020 % MGS 3.502 05/31/27 0307	2'400	0	0	2'400 MYR	100.16%	435'956.11	0.40	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	1'590	2'900	0	4'490 MYR	104.22%	848'687.16	0.78	a)
MYBMX1100044	4.2320 % MGS 4.232 06/30/31 0411	2'130	0	0	2'130 MYR	103.01%	397'924.59	0.37	a)
MYBMX1300040	3.8440 % MGS 3.844 04/15/33 0413	2'050	0	0	2'050 MYR	100.04%	371'936.74	0.34	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	3'730	500	0	4'230 MYR	108.19%	830'022.29	0.76	a)
MYBMX1800049	4.8930 % MGS 4.893 06/08/38 0418	1'700	1'700	0	3'400 MYR	110.14%	679'187.97	0.62	a)
MYBMY1500043	4.2540 % MGS 4.254 05/31/35 0415	2'150	400	0	2'550 MYR	103.10%	476'823.33	0.44	a)
MYBMY1900052	3.7570 % MGS 3.757 05/22/40 0519	3'570	400	0	3'970 MYR	96.46%	694'489.17	0.64	a)
MYBMY2200023	4.6960 % MGS 4.696 10/15/42 0222	1'600	2'110	0	3'710 MYR	108.26%	728'437.27	0.67	a)
MYBMZ1300078	4.9350 % MGS 4.935 09/30/43 0713	1'270	0	0	1'270 MYR	110.64%	254'829.92	0.23	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	1'500	400	0	1'900 MYR	108.18%	372'788.79	0.34	a)
MYBMZ1800051	4.9210 % MGS 4.921 07/06/48 0518	1'450	1'080	0	2'530 MYR	111.11%	509'842.01	0.47	a)
MYBMZ2000016	4.0650 % MGS 4.065 06/15/50 0120	4'010	400	0	4'410 MYR	98.20%	785'441.00	0.72	a)
MYBMZ2300010	4.4570 % MGS 4.457 03/31/53 0123	0	1'600	0	1'600 MYR	104.15%	302'209.86	0.28	a)
<b>MYR</b>							<b>15'269'182.56</b>	<b>14.03</b>	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	8'689	0	8'689	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	8'450	600	700	8'350 NOK	97.48%	667'763.74	0.61	a)
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	6'350	1'200	500	7'050 NOK	95.79%	553'997.05	0.51	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	6'220	1'560	815	6'965 NOK	94.97%	542'660.73	0.50	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	5'510	1'800	1'500	5'810 NOK	94.41%	450'002.54	0.41	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	5'790	550	530	5'810 NOK	91.60%	436'608.76	0.40	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	7'633	700	650	7'683 NOK	87.92%	554'133.81	0.51	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	5'290	750	0	6'040 NOK	84.93%	420'822.01	0.39	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	5'250	1'070	430	5'890 NOK	90.03%	435'014.85	0.40	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	0	3'000	0	3'000 NOK	101.38%	249'523.53	0.23	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	0	7'880	1'050	6'830 NOK	95.61%	535'706.22	0.49	a)
<b>NOK</b>							<b>4'846'233.24</b>	<b>4.45</b>	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	1'180	200	205	1'175 NZD	97.25%	603'369.90	0.55	a)
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	1'060	375	115	1'320 NZD	100.05%	697'402.31	0.64	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	1'040	265	110	1'195 NZD	93.58%	590'493.67	0.54	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	780	1'220	140	1'860 NZD	91.95%	903'110.78	0.83	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	810	290	165	935 NZD	80.41%	397'018.49	0.36	a)
NZGOVDT524C5	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/24 0524	1'120	0	1'120	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	900	230	0	1'130 NZD	91.16%	543'961.45	0.50	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	800	645	85	1'360 NZD	83.95%	602'887.41	0.55	a)
NZGOVDT530C2	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/30 0530	0	936	160	776 NZD	100.32%	411'070.51	0.38	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	910	190	0	1'100 NZD	81.56%	473'743.09	0.44	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	820	410	100	1'130 NZD	82.58%	492'744.11	0.45	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	450	310	75	685 NZD	97.00%	350'878.85	0.32	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	610	217	120	707 NZD	63.80%	238'203.69	0.22	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	670	310	70	910 NZD	68.20%	327'721.39	0.30	a)
<b>NZD</b>							<b>6'632'605.65</b>	<b>6.09</b>	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	226	0	0	226 PLN	103.20%	50'230.49	0.05	a)
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	6'226	9'300	0	15'526 PLN	91.82%	3'070'266.75	2.82	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	3'852	0	0	3'852 PLN	97.49%	808'771.03	0.74	a)
PL0000108866	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/26 0726	5'315	0	0	5'315 PLN	94.45%	1'081'146.31	0.99	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	5'248	500	750	4'998 PLN	92.55%	996'212.33	0.92	a)
PL0000111191	2.5000 % POLGB 2 1/2 04/25/24 0424	2'141	0	2'141	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	7'100	2'000	0	9'100 PLN	89.20%	1'748'177.34	1.61	a)
PL0000111720	2.2500 % POLGB 2 1/4 10/25/24 1024	3'575	0	3'575	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	6'624	1'450	2'400	5'674	PLN	95.05%	1'161'503.95	1.07 a)
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	4'851	3'140	2'270	5'721	PLN	78.86%	971'645.76	0.89 a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	8'455	1'800	1'600	8'655	PLN	88.41%	1'647'963.93	1.51 a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	5'109	7'400	0	12'509	PLN	77.72%	2'093'797.24	1.92 a)
PL0000114021	0.0000 % POLGB 0 07/25/24 0724	4'993	0	4'993	0	PLN	0.00%	0.00	0.00
PL0000114393	3.7500 % POLGB 3 3/4 05/25/27 0527	1'350	0	0	1'350	PLN	96.58%	280'802.01	0.26 a)
PL0000115283	0.0000 % POLGB 0 10/25/25 1025	0	3'900	0	3'900	PLN	92.03%	772'988.92	0.71 a)
<b>PLN</b>								<b>14'683'506.06</b>	<b>13.49</b>
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	6'300	500	820	5'980	SEK	114.22%	567'089.71	0.52 a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	6'260	1'310	750	6'820	SEK	100.49%	568'981.10	0.52 a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	10'620	1'450	800	11'270	SEK	99.42%	930'225.12	0.85 a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	11'030	1'900	1'325	11'605	SEK	96.20%	926'860.53	0.85 a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	9'090	2'265	980	10'375	SEK	94.06%	810'241.62	0.74 a)
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	9'480	1'430	1'455	9'455	SEK	92.35%	724'954.36	0.67 a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	7'070	1'600	905	7'765	SEK	86.43%	557'209.11	0.51 a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	0	7'050	0	7'050	SEK	95.90%	561'320.49	0.52 a)
<b>SEK</b>								<b>5'646'882.04</b>	<b>5.19</b>
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	987	550	105	1'432	SGD	98.77%	907'944.30	0.83 a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	949	60	70	939	SGD	97.23%	586'080.15	0.54 a)
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	1'040	270	230	1'080	SGD	98.01%	679'493.46	0.62 a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	1'148	110	95	1'163	SGD	92.99%	694'235.95	0.64 a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	670	390	125	935	SGD	99.18%	595'287.62	0.55 a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	798	210	95	913	SGD	97.69%	572'548.16	0.53 a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	883	420	115	1'188	SGD	103.89%	792'284.80	0.73 a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	922	110	75	957	SGD	99.91%	613'779.01	0.56 a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	1'375	115	220	1'270	SGD	101.77%	829'687.66	0.76 a)
SG7S30941627	3.0000 % SIGB 3 09/01/24	1'374	0	1'374	0	SGD	0.00%	0.00	0.00
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	1'217	150	165	1'202	SGD	99.85%	770'448.61	0.71 a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	659	350	125	884	SGD	95.56%	542'274.95	0.50 a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	431	260	70	621	SGD	93.27%	371'813.12	0.34 a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	876	220	170	926	SGD	81.68%	485'531.99	0.45 a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	706	320	0	1'026	SGD	95.51%	629'053.15	0.58 a)
SGXF33080817	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/27	353	80	0	433	SGD	100.12%	278'291.46	0.26 a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	340	530	95	775	SGD	97.91%	487'101.97	0.45 a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	313	490	85	718	SGD	104.69%	482'526.07	0.44 a)
SGXF51035222	2.8750 % SIGB 2 7/8 08/01/28	0	330	0	330	SGD	100.19%	212'241.08	0.19 a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	732	150	105	777	SGD	91.59%	456'835.89	0.42 a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	640	280	90	830	SGD	82.29%	438'446.18	0.40 a)
SGXF92110679	2.0000 % SIGB 2 02/01/24	1'141	0	1'141	0	SGD	0.00%	0.00	0.00
<b>SGD</b>								<b>11'425'905.58</b>	<b>10.49</b>

## Derivative Finanzinstrumente

**0.00 0.00**

### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 08.02.2023	22'000	23'849	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 23.05.2023	1'420'000	117'969	NOK/CHF	0.00	0.00
USD/SGD	Verfall 21.06.2023	93'644	70'000	SGD/USD	0.00	0.00
USD/NZD	Verfall 03.08.2023	400'000	248'954	NZD/USD	0.00	0.00
USD/MXN	Verfall 03.08.2023	2'100'000	125'716	MXN/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 01.09.2023	124'789	110'000	USD/CHF	0.00	0.00
USD/ILS	Verfall 06.11.2023	120'000	29'670	ILS/USD	0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall 03.01.2024	50'000	1'002'233	CHF/MXN	0.00	0.00

### Devisentermingeschäfte

**0.00 0.00**

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	8'896'131.67	8.17
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	98'844'250.34	90.79

Sonstige Vermögenswerte	1'130'052.95	1.04
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>108'870'434.96</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'443'569.07	
Andere Verbindlichkeiten	-69.54	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>107'426'796.35</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
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);	98'844'250.34	90.79
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

DKK	100 = CHF	12.50182200
ILS	1 = CHF	0.23581560
MXN	1 = CHF	0.04994614
MYR	1 = CHF	0.18136364
NOK	100 = CHF	8.20390900
NZD	1 = CHF	0.52804957
PLN	1 = CHF	0.21536704
SEK	100 = CHF	8.30256400
SGD	1 = CHF	0.64193512
USD	1 = CHF	0.85785000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

<b>Engagement</b>	<b>Währung</b>	<b>Betrag</b>	<b>in % 28)</b>
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

<b>Klasse</b>	<b>Währung</b>	<b>Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)</b>		<b>Durchschnitt Ausgabe- spesen in %</b>	<b>Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)</b>		<b>Durchschnitt Rücknahme- spesen in %</b>
		<b>Teilvermögen</b>	<b>Fondsleitung</b>		<b>Teilvermögen</b>	<b>Fondsleitung</b>	
FA CHF	CHF	0.00 - 0.28	-	0.272	0.00 - 0.10	-	0.092
NT CHF	CHF	0.00 - 0.28	-	0.272	0.00 - 0.10	-	0.092
ST CHF	CHF	0.00 - 0.28	-	0.272	0.00 - 0.10	-	0.092

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	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FA CHF	0.290	0.500	0.190	0.100	-
NT CHF	-	-	-	-	-
ST CHF	-	-	-	-	-

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-AUD Non-CAD Non-CHF Non-CNY Non-EMU Non-GBP Non-JPY Non-USD World Government Bond Index TR

## 9 TER

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

## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 14.05.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 17.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Ja	CHF	2.75000	0.96250	1.78750

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 14.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 17.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	Ja	CHF	3.182	1.113	2.069
ST CHF	Ja	CHF	3'469.89	1'214.46	2'255.43

## 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.
- 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:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

anfallen;

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

## **Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger**

### des **Swisscanto (CH) Index Fund II**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

mit den Teilvermögen

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH**

### und des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

mit den Teilvermögen

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency**  
**Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect**  
**Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect**  
**Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect**  
**Swisscanto (CH) Index Commodity Fund**

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, neun Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit einem Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V (nachfolgend auch "der / die Umbrella-Fonds") zu vereinigen und den Fondsvertrag des übertragenden Umbrella-Fonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu den Vereinigungen und zu den in Zusammenhang mit den Vereinigungen erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

### 1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgenden Vereinigungen durchzuführen:

Übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Stichtag der Vereinigungen (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	22. November 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.		

### 2 Gründe für die Vereinigungen

Mit den Vereinigungen soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anleger ist. Die Vereinigungen erlauben das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglichen ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

### 3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

Die Voraussetzungen für Vereinigungen sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 der Fondsverträge der Umbrella-Fonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist bei den übertragenden Teilvermögen sowie beim übernehmenden Teilvermögen in § 25 des jeweiligen Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
  - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
  - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
  - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
  - d) Die Rücknahmebedingungen;
  - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Am gleichen Tag werden die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen Kosten.

## 4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen werden mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum die übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V vereinigt. Die Vereinigungen erfolgen durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen werden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anleger und Anlegerinnen der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V. Die Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen entsprechen dabei jeweils inhaltlich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigungen überführt werden.

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR

Am 23. November 2023 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V bzw. übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II aufgrund der Schlusskurse vom 22. November 2023 durchgeführt. Am 23. November 2023 (Bewertungstag), erfolgen die Vereinigungen durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf 22. November 2023 (Vereinigungstichtag).

## 5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 8. August 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen erfüllt sind.

## 6 Vollzug der Vereinigungen

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigungen überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigungen durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigungen mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie den Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen auf [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com) veröffentlichen.

## 7 Kosten

Den übertragenden (und dem übernehmenden) Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

## 8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen wird die Ausgabe bzw. Rückzahlung von Anteilen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und des übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

### (übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

### (übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

**Stichtag Vereinigung**

22. November 2023

## 9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigungen führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigungen lösen auf Ebene der an den Vereinigungen beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

### Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

Im Hinblick auf die Vereinigungen muss der Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II angepasst werden.

#### 1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 25 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II sowie des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen der übertragenden Teilvermögen für die Vereinigungen mit dem übernehmenden Teilvermögen in Einklang mit den betreffenden Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2, 2.3 und 2.4 nachstehend).
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend).
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4 nachstehend).
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend).
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend).

#### 2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

##### 2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigungen und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens, bedarf es einer Anpassung der Bestimmungen der Anlagepolitik des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen lautet neu wie folgt:

*"Anlagen in OTC-Derivate (OTC-Geschäften) sind nur zulässig, wenn (i) die Gegenpartei ein beaufsichtigter, auf dieses Geschäft spezialisierter Finanzintermediär ist, und (ii) die OTC-Derivate täglich handelbar sind oder eine Rückgabe an den Emittenten jederzeit möglich ist. Zudem sind sie zuverlässig und nachvollziehbar bewertbar. Derivate können gemäss § 12 eingesetzt werden.*

*Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen (Zielfonds). Als "andere kollektive Kapitalanlagen" im Sinne dieses Fondsvertrages gelten:*

- *inländische kollektive Kapitalanlagen der Art "Effektenfonds", "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"), wenn deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen.*
- *ausländische offene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und bei denen die Auszahlung von Rücknahme-*

oder Rückkaufsbefugnissen keinen Beschränkungen unterliegt. Es handelt sich um kollektive Kapitalanlagen, (i) deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen; (ii) für welche in Bezug auf Zweck, Organisation, Anlagepolitik, Anlegerschutz, Risikoverteilung, getrennte Verwahrung des Fondsvermögens, Kreditaufnahme, Kreditgewährung, Leerverkäufe von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, Ausgabe und Rücknahme der Anteile bzw. Aktien und Inhalt der Halbjahres- und Jahresberichte gleichwertige Bestimmungen gelten wie für Effektenfonds oder Fonds der Art „Übrige Fonds für traditionelle Anlagen“ und (iii) welche im Sitzstaat als kollektive Kapitalanlagen zugelassen sind und dort einer dem Anlegerschutz dienenden, der schweizerischen gleichwertigen Aufsicht unterstehen, und die internationale Amtshilfe gewährleistet ist.

- ausländische geschlossene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und deren Dokumente die Anlagen in andere Zielfonds ihrerseits insgesamt auf 30% begrenzen. Solche geschlossene kollektive Kapitalanlagen unterliegen in ihrem Heimatstaat überwiegend keiner Aufsicht. Soweit solche kollektive Kapitalanlagen in ihrem Heimatstaat einer Aufsicht unterliegen, wird diese nicht notwendigerweise nach der Praxis der Schweizer Aufsichtsbehörde als "gleichwertig" eingestuft. Zudem wird die internationale Amtshilfe nicht zwingend gewährleistet. Die Anlagepolitik der geschlossenen kollektiven Kapitalanlagen muss derjenigen eines Effektenfonds oder eines übrigen Fonds für traditionelle Anlagen gleichwertig sein (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"). Ihre Anteile bzw. Aktien müssen an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.
- Beteiligungen an Immobilienfonds (einschliesslich Real Estate Investment Trusts, REITs), die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.

Die Rücknahmefrequenz oder Liquidität der Zielfonds hat grundsätzlich derjenigen des betreffenden Teilvermögens zu entsprechen. Die Verwendung von Zielfonds darf nicht zu einer Veränderung des Anlagecharakters eines Teilvermögens führen. Nach ihrer Rechtsform kann es sich bei den Zielfonds um vertragsrechtliche Anlagefonds, kollektive Kapitalanlagen in gesellschaftsrechtlicher Form, liechtensteinische Treuunternehmen, Business Trusts nach dem Recht US-amerikanischer Gliedstaaten, Investmentvereine oder um Unit Trusts handeln.

Die Fondsleitung kann Anteile bzw. Aktien von offenen kollektiven Kapitalanlagen sowohl aus Ausgabe wie auf dem Sekundärmarkt erwerben und Anteile bzw. Aktien sowohl zurückgeben wie auf dem Sekundärmarkt veräussern.

Die Fondsleitung darf unter Vorbehalt von § 20 Ziff. 6 Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) erwerben, die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist. "

Die teilvermögensspezifische Anlagepolitik in § 8 Ziff. 4 bis 12 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird wie folgt angepasst:

"Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE EMU Government Bond Index nach. Dabei kann die Fondsleitung, statt in sämtliche Titel des Referenzindex zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimized Sampling).

Das Teilvermögen

- a) investiert in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte von privaten, gemischtwirtschaftlichen und öffentlich-rechtlichen Schuldnern, welche Bestandteil des Referenzindex sind;
- b) darf vorübergehend in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte investieren, die nicht im Referenzindex enthalten sind, von denen jedoch aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist, dass sie in den Referenzindex aufgenommen werden;
- c) darf in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte investieren, die aufgrund des Kriteriums Mindestrestlaufzeit aus dem Referenzindex gestrichen wurden;

- d) investiert in Derivate auf den Referenzindex oder Teilsegmente des Referenzindex und die oben erwähnten Anlagen sowie Indices, die dem Referenzindex bzw. Teilsegmenten des Referenzindex nahestehen und die eine hohe Korrelation zum Referenzindex bzw. zum entsprechenden Teilsegment des Referenzindex aufweisen;
- e) weist eine Modified Duration auf, die um nicht mehr als 0.5 von der Modified Duration des Referenzindex abweicht.
- f) investiert in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen, die auf den Referenzindex oder Teilsegmente des Referenzindex lauten sowie auf Indices lauten, die dem Referenzindex bzw. Teilsegmenten des Referenzindex nahestehen und die eine hohe Korrelation zum Referenzindex bzw. zum entsprechenden Teilsegment des Referenzindex aufweisen;

Mit Ausnahme der Anlagen gemäss lit. c oben müssen Anlagen (einschliesslich Derivate auf diesen Anlagen), die aus dem Referenzindex gestrichen werden, unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist veräussert werden.

Die Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss lit. f oben dürfen 30% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten."

## 2.2 Flüssige Mittel

In den Vorschriften über flüssige Mittel (vgl. § 9 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen) wird präzisiert, dass die Fondsleitung für jedes Teilvermögen zusätzlich angemessene flüssige Mittel in der weiteren Zeichnungs-/Rücknahmewährung der Anteilsklassen halten darf.

## 2.3 Anlagetechniken und -instrumente

Die zu beurteilenden Vorschriften innerhalb der Effektenleihe der zu vereinigenden Teilvermögen werden dahingehend angepasst, dass die Fondsleitung für Rechnung der Teilvermögen Effektenleihe-Geschäfte tätigen darf (vgl. § 10 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen). In der Folge lauten die neuen Bestimmungen:

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen sämtliche Arten von Effekten ausleihen, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen worden sind, dürfen hingegen nicht ausgeliehen werden.
2. Die Fondsleitung kann die Effekten im eigenen Namen und auf eigene Rechnung einem Borger ausleihen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, die Effekten entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") einem Borger zur Verfügung zu stellen.
3. Die Fondsleitung tätigt die Effektenleihe nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Borgern und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahrern, die eine einwandfreie Durchführung der Effektenleihe gewährleisten.
4. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerktag nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die ausgeliehenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom ausleihfähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% ausleihen. Sichert hingegen der Borger oder der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerktag wieder rechtlich über die ausgeliehenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte ausleihfähige Bestand einer Art ausgeliehen werden.
5. Die Fondsleitung vereinbart mit dem Borger oder Vermittler, dass dieser zwecks Sicherstellung des Rückerstattungsanspruches zugunsten der Fondsleitung Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA verpfändet oder zu Eigentum überträgt. Der Wert der Sicherheiten muss angemessen sein und jederzeit mindestens 100% des Verkehrswerts der ausgeliehenen Effekten betragen. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art.

52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.

6. Der Borger oder Vermittler haftet für die pünktliche und uneingeschränkte Vergütung der während der Effektenleihe anfallenden Erträge, die Geltendmachung anderer Vermögensrechte sowie die vertragskonforme Rückerstattung von Effekten gleicher Art, Menge und Güte.
7. Die Depotbank sorgt für eine sichere und vertragskonforme Abwicklung der Effektenleihe und überwacht namentlich die Einhaltung der Anforderungen an die Sicherheiten. Sie besorgt auch während der Dauer der Leihgeschäfte die ihr gemäss Depotreglement obliegenden Verwaltungshandlungen und die Geltendmachung sämtlicher Rechte auf den ausgeliehenen Effekten, soweit diese nicht gemäss anwendbarem Rahmenvertrag abgetreten wurden.
8. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens darf die Fondsleitung auf Rechnung der Teilvermögen Pensionsgeschäfte abschliessen (vgl. § 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen). Die neuen Bestimmungen lauten wie folgt:

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen Pensionsgeschäfte abschliessen. Pensionsgeschäfte können entweder als "Repo" oder als "Reverse Repo" getätigt werden.

Das Repo ist ein Rechtsgeschäft, durch das eine Partei (Pensionsgeber) das Eigentum an Effekten gegen Bezahlung vorübergehend auf eine andere Partei (Pensionsnehmer) überträgt, und bei dem der Pensionsnehmer sich verpflichtet, dem Pensionsgeber bei Fälligkeit Effekten gleicher Art, Menge und Güte sowie die während der Dauer des Pensionsgeschäftes anfallenden Erträge zurückzuerstatten. Der Pensionsgeber trägt das Kursrisiko der Effekten während der Dauer des Pensionsgeschäftes.

Das Repo ist aus der Sicht der Gegenpartei (Pensionsnehmer) ein Reverse Repo. Mit einem Reverse Repo erwirbt die Fondsleitung zwecks Geldanlage Effekten und vereinbart gleichzeitig, Effekten gleicher Art, Menge und Güte sowie die während der Dauer des Pensionsgeschäftes anfallenden Erträge zurückzuerstatten.

2. Die Fondsleitung kann Pensionsgeschäfte im eigenen Namen und auf eigene Rechnung mit einer Gegenpartei abschliessen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") Pensionsgeschäfte mit einer Gegenpartei zu tätigen.
3. Die Fondsleitung tätigt Pensionsgeschäfte nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Gegenparteien und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahren, die eine einwandfreie Durchführung des Pensionsgeschäftes gewährleisten.
4. Die Depotbank sorgt für eine sichere und vertragskonforme Abwicklung des Pensionsgeschäftes. Sie sorgt dafür, dass die Wertveränderungen der im Pensionsgeschäft verwendeten Effekten täglich in Geld oder Effekten ausgeglichen werden (mark to market) und besorgt auch während der Dauer des Pensionsgeschäftes die ihr gemäss Depotreglement obliegenden Verwaltungshandlungen und die Geltendmachung sämtlicher Rechte auf den im Pensionsgeschäft verwendeten Effekten, soweit diese nicht gemäss anwendbarem Rahmenvertrag abgetreten wurden.

5. Die Fondsleitung darf für Repos sämtliche Arten von Effekten verwenden, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen wurden, dürfen nicht für Repos verwendet werden.
6. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerkzeuge nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die in Pension gegebenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom repofähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% für Repos verwenden. Sichert hingegen die Gegenpartei bzw. der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerkzeug wieder rechtlich über die in Pension gegebenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte repofähige Bestand einer Art für Repos verwendet werden.
7. Repos gelten als Kreditaufnahme gemäss § 13, es sei denn, die erhaltenen Mittel werden für die Übernahme von Effekten gleicher Art, Güte, Bonität und Laufzeit in Verbindung mit dem Abschluss eines Reverse Repo verwendet.
8. Die Fondsleitung darf im Rahmen eines Reverse Repo nur Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA erwerben. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörenden oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art. 52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.
9. Forderungen aus Reverse Repo gelten als flüssige Mittel gemäss § 9 und nicht als Kreditgewährung gemäss § 13.
10. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

Sodann wird, in Angleichung an die Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens, in § 12 Ziff. 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen betreffend weitere Angaben zu bestimmten Themen im Prospekt die bestehende Aufzählung angepasst. Angaben zu der allfällig aus der Verwendung von Derivaten resultierenden erhöhten Volatilität sowie Angaben zum allfälligen Einsatz von Kreditderivaten sind nicht mehr im Prospekt enthalten.

## 2.4 Risikoverteilung und Risiken

Die Fondsleitung hat neu die Limite von 10% (bisher 20%) bei Anlagen von Vermögen eines Teilvermögens in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten einschliesslich Derivate zu berücksichtigen. Diese Grenze von 10% ist auf 20% angehoben, wenn der Emittent (oder ein allfälliger Garant) ein Rating von mindestens A- (S&P oder ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) aufweist oder wenn die Fondsleitung den Emittenten bzw. Garanten bei Fehlen eines Agenturratings gestützt auf ein internes Rating der Depotbank als von gleicher Qualität einstuft. Der Gesamtwert der Effekten und Geldmarktinstrumente der Emittenten, bei welchen mehr als 5% (bisher 10%) des Vermögens eines Teilvermögens angelegt sind, darf 40% (bisher 60%) des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens nicht übersteigen (vgl. § 15 Ziff. 3, 4, 13 und 14 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

Zudem wird in § 13 Ziff. 5 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen präzisiert, dass sofern das Rating A-1 oder gleichwertig erreicht, die Beschränkung für Anlagen in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank 30% statt 20% des Vermögens eines Teilvermögens beträgt.

Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss § 13 Ziff. 3 bis 9 desselben Emittenten bzw. Schuldners dürfen insgesamt 30% des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen (bisher 20%) (vgl. § 15 Ziff. 7 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

Die Bestimmung, wonach die Fondsleitung keine Beteiligungsrechte erwerben darf, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben, wird neu in § 13 Ziff. 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen aufgeführt.

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens werden weitere Ergänzungen vorgenommen. Die in Ziff. 3 von § 13 erwähnte Grenze ist von 10% auf 20% angehoben, wenn es sich um Pfandbriefe schweizerischer Pfandbriefinstitute mit erstklassigem Rating (AAA Rating von Standard & Poor's bzw. ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) handelt. Pfandbriefe bleiben bei der Anwendung der Grenze von 40% nach Ziff. 3 ausser Betracht. Zudem wird neu festgehalten, dass wenn für die Verpflichtungen ein Emittent bzw. eine Gegenpartei wie ein Garant einsteht, kann bei der Beurteilung des Gesamtengagements bei besserem Rating auch auf den Garant abgestellt werden. Sollte das Rating einer Gegenpartei oder eines Garanten unter das geforderte Mindestrating sinken, so sind die noch offenen Positionen unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist glattzustellen (vgl. § 13 Ziff. 15, 17 und 18 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

### **3 Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten**

In § 23 Ziff. 1 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird die Bestimmung ersatzlos gestrichen, wonach in jedem Fall mindestens 70% des jährlichen Nettoertrags inklusive der vorgetragenen Erträge früherer Rechnungsjahre ausgeschüttet werden.

### **4 Art, Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen**

In § 20 Ziff. 5 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird neu ausgeführt, dass die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen höchstens 3% p.a. betragen darf. Im Jahresbericht ist der maximale Satz der Verwaltungskommission der Zielfonds, in die investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen für diese Teilvermögen anzugeben.

### **5 Rücknahmebedingungen**

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens wird in § 17 Ziff. 1 die Definition des Bankwerktages präzisiert. Als Bankwerktag gilt jeder Tag, an welchem die Banken in der Stadt Zürich geöffnet sind. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen und stadtzürcherischen Feiertagen statt sowie an Tagen, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind (vgl. § 16 Ziff. 1) oder wenn ausserordentliche Verhältnisse im Sinne von § 17 Ziff. 5 vorliegen.

Darüber hinaus wird ergänzt, dass die Ausgabe- und Rücknahmepreise auf jeweils vier Stellen nach dem Komma gerundet werden; vorbehalten bleiben Sonderfälle.

## 6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

Die Laufzeit des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen und des übernehmenden Teilvermögens sowie die Voraussetzungen der Auflösung bei den zu vereinigenden Teilvermögen stimmen grundsätzlich überein.

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Teil II Ziff. 2 und 5 der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge erstreckt.

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 18. September 2023

### **Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### **Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

### des **Swisscanto (CH) Index Fund II**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.  
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.  
(nachfolgend "übertragende Teilvermögen")

### und des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.  
(nachfolgend "übernehmendes Teilvermögen")

hinsichtlich

## **Vereinigungen vom 22. November 2023**

Zur Bekanntgabe:

1. des Vollzuges der Vereinigungen;
2. der Umtauschverhältnisse; und
3. der Bestätigung der Prüfgesellschaft.

### **1 Vollzug der Vereinigungen**

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben die übertragenden Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 22. November 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 18. September 2023 in den Publikationsorganen der von den Vereinigungen betroffenen Teilvermögen über die geplanten Vereinigungen und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen wurden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 22. November 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögen auch für die übertragenden Teilvermögen.

### **2 Umtauschverhältnis**

Die Fondsleitung ermittelte das Umtauschverhältnis, welches von der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft Ernst & Young AG geprüft und für korrekt befunden wurde.

## 2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger der übertragenden Teilvermögen erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigungen basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 22. November 2023:

<b>Übertragende Teilvermögen</b>			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.	NT EUR	CH0215803948	EUR 92.68
	ST EUR	CH0302432049	EUR 84'132.27
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.	NT EUR	CH0215803989	EUR 96.07
	ST EUR	CH0302432064	EUR 85'512.87
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.	NT EUR	CH0215804037	EUR 92.78
	ST EUR	CH0302432072	EUR 85'501.30
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.	NT EUR	CH0215804086	EUR 96.31
	ST EUR	CH0302432098	EUR 87'100.07
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	NT EUR	CH0215804110	EUR 94.48
	ST EUR	CH0302432130	EUR 86'717.01
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.	NT EUR	CH0215804128	EUR 99.91
	ST EUR	CH0302432148	EUR 87'805.08
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.	NT EUR	CH0215804268	EUR 110.75
	ST EUR	CH0302432163	EUR 93'922.69
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	NT EUR	CH0215804300	EUR 92.82
	ST EUR	CH0302432171	EUR 84'390.42
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	NT EUR	CH0215804342	EUR 108.42
	ST EUR	CH0302432254	EUR 93'153.61

<b>Übernehmendes Teilvermögen</b>			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	NT EUR	CH0117045150	EUR 113.84

## 2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergeben sich folgende Umtauschverhältnisse aus Sicht des jeweiligen übertragenden Teilvermögen (1 Anteil des übertragenden Teilvermögen ↔ Anzahl Anteile des übernehmenden Teilvermögen):

<b>Übertragende Teilvermögen</b>		
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis <sup>1</sup>
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.	NT EUR	1 zu 0.8141069428
	ST EUR	1 zu 739.0454261124
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.	NT EUR	1 zu 0.8438950298
	ST EUR	1 zu 751.1730216961
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.	NT EUR	1 zu 0.8149953411
	ST EUR	1 zu 751.0714046741
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.	NT EUR	1 zu 0.8459861506
	ST EUR	1 zu 765.1154933048
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	NT EUR	1 zu 0.8299593985
	ST EUR	1 zu 761.7506315166
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.	NT EUR	1 zu 0.8776731516
	ST EUR	1 zu 771.3085595374
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.	NT EUR	1 zu 0.9728371650

<b>Übertragende Teilvermögen</b>	<b>Anteilsklasse</b>	<b>Umtauschverhältnis<sup>1</sup></b>
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	ST EUR	1 zu 825.0476743532
	NT EUR	1 zu 0.8153282314
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	ST EUR	1 zu 741.3130290303
	NT EUR	1 zu 0.9524302585
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	ST EUR	1 zu 818.2917647532

<sup>1</sup> Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

### 3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 30. November 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung der Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund II») mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund V») per 22. November 2023 geprüft.

Für die Berechnung der Umtauschverhältnisse ist die Fondsleitung verantwortlich, während unsere Aufgabe darin besteht, die Berechnung der Umtauschverhältnisse zu prüfen und zu beurteilen.

Unsere Prüfung erfolgte nach den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH), wonach eine Prüfung so zu planen und durchzuführen ist, dass wesentliche Fehlaussagen in der Berechnung der Umtauschverhältnisse mit angemessener Sicherheit erkannt werden. Wir prüften die Grundlagen der Berechnung der Umtauschverhältnisse mittels Analysen und Erhebungen auf der Basis von Stichproben. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine ausreichende Grundlage für unser Urteil bildet.

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigungen gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt.

Ernst & Young AG  
Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber"

\*\*\*

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 21. Dezember 2023

#### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich