

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND JAPAN 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»

Klasse	Valor	Währung
FA	21580459	JPY
NT	21580462	JPY
ST	38328825	JPY

Rechnungswährung: JPY

Weitere Informationen stehen im Internet unter 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 Unvollständigkeits, 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	12
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	12
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	12
7	Pauschale Verwaltungskommission	13
8	Benchmark	13
9	TER	13
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	14
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	14
12	Fussnoten	14
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	15
14	Pflichtpublikationen	17

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
Konsolidiert					
	JPY				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		87'612'064'266.00	69'064'368'650.00	115'416'705'575.00	83'964'322'194.00
Klasse FA					
	JPY				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		46'327'839'612.00	38'040'931'138.00	72'185'910'125.00	42'965'869'475.00
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'311'509.919	4'310'698.032	7'542'743.364	4'413'356.341
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		8'722.1600	8'824.7700	9'570.2500	9'735.4200
Ausschüttung je Anteil		75.00	72.00	73.00	79.00
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %
Klasse NT					
	JPY				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'684'379'289.00	11'815'960'769.00	21'470'003'865.00	16'967'691'679.00
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'386'729.059	1'191'096.423	2'008'390.632	1'570'622.726
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		9'868.1000	9'920.2400	10'690.1500	10'803.1600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		57.9124	70.0851	86.3794	91.7951
Thesaurierung je Anteil		103.95	101.35	103.22	109.56
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse ST					
	JPY				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		27'599'845'365.00	19'207'476'743.00	21'760'791'585.00	24'030'761'040.00
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'973.950	2'058.774	2'164.469	2'365.252
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		9'280'534.4300	9'329'570.2900	10'053'639.7500	10'159'915.7500
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		54'464.2139	65'912.1281	81'236.2013	86'329.4431
Thesaurierung je Anteil		97'764.04	95'318.91	97'077.09	103'038.16
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	-0.38 %	0.29 %	-7.55 %	-0.27 %
Klasse NT	-0.18 %	0.49 %	-7.37 %	-0.07 %
Klasse ST	-0.18 %	0.49 %	-7.37 %	-0.07 %
Benchmark	-0.21 %	0.48 %	-7.43 %	-0.22 %
Tracking Error ³³⁾	0.19 %	0.19 %	0.04 %	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	-0.17 %
Klasse NT	0.03 %
Klasse ST	0.03 %

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	311'921'946.00	132'669'694.00
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	87'060'804'268.00	68'739'133'880.00
Sonstige Vermögenswerte	247'787'633.00	199'236'630.00
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	87'620'513'847.00	69'071'040'204.00
Andere Verbindlichkeiten	-8'449'581.00	-6'671'554.00
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	87'612'064'266.00	69'064'368'650.00

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'310'698.032	7'542'743.364
Ausgegebene Anteile		7'786'345.607	1'207'135.603
Zurückgenommene Anteile		-6'785'533.720	-4'439'180.935
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'311'509.919	4'310'698.032

Klasse NT	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'191'096.423	2'008'390.632
Ausgegebene Anteile		197'381.636	294'050.295
Zurückgenommene Anteile		-1'749.000	-1'111'344.504
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'386'729.059	1'191'096.423

Klasse ST	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'058.774	2'164.469
Ausgegebene Anteile		1'042.851	1'111.167
Zurückgenommene Anteile		-127.675	-1'216.862
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'973.950	2'058.774

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		69'064'368'650.00	115'416'705'575.00
Ausbezahlte Ausschüttung		-18'982'145.00	-599'710'821.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-126'859'445.00	-168'291'904.00
Saldo aus dem Anteilverkehr		17'733'504'807.00	-38'644'835'435.00
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		960'032'399.00	-6'939'498'765.00
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		87'612'064'266.00	69'064'368'650.00

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		33'120.00	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'175'520.00	-2'695'186.00
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		708'597'410.00	916'589'439.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		295'714'886.00	62'217'870.00
Total Ertrag		1'003'169'896.00	976'112'123.00
Aufwand			
Passivzinsen		-42'298.00	0.00
Reglementarische Vergütungen		-63'023'602.00	-107'417'936.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-109'761'305.00	-244'812'350.00
Total Aufwand		-172'827'205.00	-352'230'286.00
Nettoertrag / Verlust		830'342'691.00	623'881'837.00
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'002'185'945.00	-3'226'008'760.00
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		213'000'094.00	64'781'238.00
Realisierter Erfolg		-1'958'843'160.00	-2'537'345'685.00
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'918'875'559.00	-4'402'153'080.00
Gesamterfolg		960'032'399.00	-6'939'498'765.00

Verwendung des Erfolges

Klasse FA	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	395'441'783.00	306'919'689.00
Vortrag des Vorjahres	3'936'298.00	7'386'867.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	399'378'081.00	314'306'556.00
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	398'363'243.78	310'370'257.90
Vortrag auf neue Rechnung	1'014'837.22	3'936'298.10
Total	399'378'081.00	314'306'556.00

Klasse NT	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	144'155'520.00	120'722'039.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	144'155'520.00	120'722'039.00
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	50'454'432.00	42'252'713.65
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	93'701'088.00	78'469'325.35
Total	144'155'520.00	120'722'039.00

Klasse ST	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	290'745'388.00	196'240'109.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	290'745'388.00	196'240'109.00
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	101'760'885.80	68'684'038.15
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	188'984'502.20	127'556'070.85
Total	290'745'388.00	196'240'109.00

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 JPY	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							87'060'804'268	99.36	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							87'060'804'268	99.36	
JP1024321N19	0.0050 % JGB 0.005 01/01/24 432	328'000	0	328'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	302'000	0	302'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024341N31	0.0050 % JGB 0.005 03/01/24 434	385'000	0	385'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024351N46	0.0050 % JGB 0.005 04/01/24 435	250'000	60'000	310'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024361N51	0.0050 % JGB 0.005 05/01/24 436	100'000	150'000	250'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024371N67	0.0050 % JGB 0.005 06/01/24 437	234'000	170'000	404'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024381N73	0.0050 % JGB 0.005 07/01/24 438	0	333'000	333'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024391N89	0.0050 % JGB 0.005 08/01/24 439	0	368'000	368'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024401N95	0.0050 % JGB 0.005 09/01/24 440	0	687'000	687'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	0	652'000	652'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024421NB7	0.0050 % JGB 0.005 11/01/24 442	300'000	360'000	660'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	300'000	389'000	689'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1024441P12	0.0050 % JGB 0.005 01/01/25 444	0	947'000	392'400	554'600 JPY	100.04%	554'844'024	0.63	a)
JP1024451P27	0.0050 % JGB 0.005 02/01/25 445	0	794'000	386'350	407'650 JPY	100.03%	407'784'525	0.47	a)
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	0	422'000	100'000	322'000 JPY	100.03%	322'083'720	0.37	a)
JP1024471P49	0.0050 % JGB 0.005 04/01/25 447	0	295'000	0	295'000 JPY	100.03%	295'088'500	0.34	a)
JP1024481P54	0.0050 % JGB 0.005 05/01/25 448	0	369'000	0	369'000 JPY	100.01%	369'029'520	0.42	a)
JP1024491P60	0.0050 % JGB 0.005 06/01/25 449	0	462'000	0	462'000 JPY	100.00%	461'981'520	0.53	a)
JP1024501P76	0.0050 % JGB 0.005 07/01/25 450	0	415'000	0	415'000 JPY	99.98%	414'929'450	0.47	a)
JP1024511P82	0.0050 % JGB 0.005 08/01/25 451	0	300'000	0	300'000 JPY	99.97%	299'904'000	0.34	a)
JP1024521P98	0.0050 % JGB 0.005 09/01/25 452	0	480'000	0	480'000 JPY	99.95%	479'774'400	0.55	a)
JP1024531PA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/25 453	0	475'000	0	475'000 JPY	99.94%	474'691'250	0.54	a)
JP1024541PB7	0.1000 % JGB 0.1 11/01/25 454	0	350'000	0	350'000 JPY	100.10%	350'339'500	0.40	a)
JP1024551PC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/25 455	0	200'000	0	200'000 JPY	99.88%	199'752'000	0.23	a)
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	395'000	0	395'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	551'000	110'000	661'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1051411KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/24 141	321'000	139'000	460'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	328'000	263'000	244'200	346'800 JPY	100.14%	347'288'988	0.40	a)
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	333'000	133'000	200'850	265'150 JPY	100.14%	265'521'210	0.30	a)
JP1051441L76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/25 144	486'000	217'000	293'500	409'500 JPY	100.13%	410'044'635	0.47	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	318'000	178'000	201'550	294'450 JPY	100.11%	294'779'784	0.34	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	273'000	371'000	287'150	356'850 JPY	100.06%	357'056'973	0.41	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	419'000	265'000	327'250	356'750 JPY	99.86%	356'236'280	0.41	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	446'000	204'000	352'500	297'500 JPY	99.83%	297'000'200	0.34	a)
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	407'000	246'000	229'650	423'350 JPY	99.81%	422'528'701	0.48	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	636'000	291'700	422'050	505'650 JPY	99.75%	504'385'875	0.58	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	0	773'000	345'600	427'400 JPY	99.68%	426'019'498	0.49	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	0	438'000	188'300	249'700 JPY	100.01%	249'712'485	0.28	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	0	993'000	343'600	649'400 JPY	99.59%	646'763'436	0.74	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	0	849'000	362'150	486'850 JPY	99.77%	485'744'851	0.55	a)
JP1051551P11	0.3000 % JGB 0.3 12/20/27 155	0	256'600	87'150	169'450 JPY	100.46%	170'231'165	0.19	a)
JP1051561P27	0.2000 % JGB 0.2 12/20/27 156	0	628'450	355'800	272'650 JPY	100.08%	272'857'214	0.31	a)
JP1051571P41	0.2000 % JGB 0.2 03/20/28 157	0	319'000	0	319'000 JPY	99.93%	318'786'270	0.36	a)
JP1051581P56	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 158	0	705'600	230'000	475'600 JPY	99.52%	473'336'144	0.54	a)
JP1051591P70	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 159	0	506'000	150'000	356'000 JPY	99.39%	353'821'280	0.40	a)
JP1051601P86	0.2000 % JGB 0.2 06/20/28 160	0	200'000	0	200'000 JPY	99.82%	199'644'000	0.23	a)
JP1051611P92	0.3000 % JGB 0.3 06/20/28 161	0	380'000	0	380'000 JPY	100.26%	380'969'000	0.43	a)
JP1051621PA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/28 162	0	455'000	0	455'000 JPY	100.11%	455'505'050	0.52	a)
JP1051631PB2	0.4000 % JGB 0.4 09/20/28 163	0	600'000	0	600'000 JPY	100.57%	603'414'000	0.69	a)
JP1103331E36	0.6000 % JGB 0.6 03/20/24 333	419'000	0	419'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1103341E67	0.6000 % JGB 0.6 06/20/24 334	372'000	0	372'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	327'000	210'000	537'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1103361EC6	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/24 336	110'000	65'000	175'000	0 JPY	0.00%	0	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 JPY	in % 7)	Kat.
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	162'000	111'000	108'200	164'800 JPY	100.32%	165'322'416	0.19	a)
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	202'000	243'000	236'000	209'000 JPY	100.48%	209'999'020	0.24	a)
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	178'000	122'000	116'700	183'300 JPY	100.55%	184'302'651	0.21	a)
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	166'000	136'000	134'700	167'300 JPY	100.60%	168'307'146	0.19	a)
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	163'000	89'000	101'700	150'300 JPY	100.43%	150'952'302	0.17	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	139'000	127'000	89'250	176'750 JPY	100.06%	176'852'515	0.20	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	167'000	77'000	101'400	142'600 JPY	100.06%	142'681'282	0.16	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	352'000	118'000	223'950	246'050 JPY	100.06%	246'185'328	0.28	a)
JP1103451GCO	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	403'000	276'000	290'950	388'050 JPY	100.02%	388'143'132	0.44	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	401'000	149'000	247'600	302'400 JPY	99.97%	302'318'352	0.35	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	461'000	123'000	352'450	231'550 JPY	99.91%	231'350'867	0.26	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	322'000	120'000	202'650	239'350 JPY	99.77%	238'806'676	0.27	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	179'000	252'000	194'850	236'150 JPY	99.69%	235'417'935	0.27	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	262'000	164'000	169'400	256'600 JPY	99.52%	255'378'584	0.29	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	239'000	150'000	188'050	200'950 JPY	99.39%	199'720'186	0.23	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	219'000	169'000	164'750	223'250 JPY	99.24%	221'557'765	0.25	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	238'000	188'000	187'850	238'150 JPY	99.08%	235'966'165	0.27	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	138'000	162'000	131'100	168'900 JPY	98.95%	167'126'550	0.19	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	196'000	219'000	171'450	243'550 JPY	98.89%	240'856'337	0.27	a)
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	199'000	193'000	166'950	225'050 JPY	98.78%	222'311'142	0.25	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	505'000	93'000	368'900	229'100 JPY	98.67%	226'046'097	0.26	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	320'000	234'000	320'000	234'000 JPY	98.50%	230'497'020	0.26	a)
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	479'000	331'000	504'450	305'550 JPY	98.29%	300'325'095	0.34	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	207'000	196'000	143'450	259'550 JPY	98.13%	254'696'415	0.29	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	375'000	146'000	335'300	185'700 JPY	97.90%	181'792'872	0.21	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	489'000	188'000	445'250	231'750 JPY	97.58%	226'137'015	0.26	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	586'000	282'000	528'750	339'250 JPY	97.30%	330'093'643	0.38	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	390'000	156'000	256'650	289'350 JPY	96.94%	280'495'890	0.32	a)
JP1103651N11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/31 365	144'000	299'000	168'400	274'600 JPY	96.71%	265'571'152	0.30	a)
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	120'000	182'000	120'000	182'000 JPY	96.93%	176'419'880	0.20	a)
JP1103681NA2	0.2000 % JGB 0.2 09/20/32 368	0	144'000	0	144'000 JPY	96.66%	139'183'200	0.16	a)
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	0	473'000	297'700	175'300 JPY	98.90%	173'368'194	0.20	a)
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	0	851'000	375'000	476'000 JPY	98.69%	469'759'640	0.54	a)
JP1103711P74	0.4000 % JGB 0.4 06/20/33 371	0	832'700	0	832'700 JPY	97.53%	812'107'329	0.93	a)
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	1'005'000	0	1'005'000 JPY	101.01%	1'015'100'250	1.16	a)
JP1200671434	1.9000 % JGB 1.9 03/20/24 67	135'000	0	135'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1200691457	2.1000 % JGB 2.1 03/20/24 69	200'000	0	200'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1200701462	2.4000 % JGB 2.4 06/20/24 70	249'000	0	249'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	303'000	113'000	416'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	177'000	136'000	123'050	189'950 JPY	101.82%	193'407'090	0.22	a)
JP1200751533	2.1000 % JGB 2.1 03/20/25 75	84'000	18'000	0	102'000 JPY	102.40%	104'445'960	0.12	a)
JP1200761540	1.9000 % JGB 1.9 03/20/25 76	123'000	107'000	113'750	116'250 JPY	102.17%	118'774'950	0.14	a)
JP1200781563	1.9000 % JGB 1.9 06/20/25 78	109'000	81'000	76'300	113'700 JPY	102.62%	116'677'803	0.13	a)
JP1200811592	2.0000 % JGB 2 09/20/25 81	118'000	83'000	81'250	119'750 JPY	103.21%	123'597'568	0.14	a)
JP12008215A7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/25 82	99'000	71'000	67'250	102'750 JPY	103.38%	106'218'840	0.12	a)
JP12008315C1	2.1000 % JGB 2.1 12/20/25 83	104'000	78'000	72'000	110'000 JPY	103.82%	114'199'800	0.13	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	154'000	101'000	100'600	154'400 JPY	103.63%	160'004'720	0.18	a)
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	159'000	110'000	105'800	163'200 JPY	104.31%	170'232'288	0.19	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	112'000	87'000	76'700	122'300 JPY	104.73%	128'089'682	0.15	a)
JP1200871653	2.2000 % JGB 2.2 03/20/26 87	109'000	83'000	75'700	116'300 JPY	104.52%	121'557'923	0.14	a)
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	172'000	126'000	117'950	180'050 JPY	105.29%	189'567'443	0.22	a)
JP1200891685	2.2000 % JGB 2.2 06/20/26 89	94'000	73'000	65'600	101'400 JPY	105.05%	106'518'672	0.12	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	197'000	106'000	91'100	211'900 JPY	105.57%	223'709'187	0.26	a)
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	319'000	207'000	197'650	328'350 JPY	105.77%	347'305'646	0.40	a)
JP1200931739	2.0000 % JGB 2 03/20/27 93	194'000	69'000	124'500	138'500 JPY	105.90%	146'668'730	0.17	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	325'000	116'000	209'800	231'200 JPY	106.21%	245'557'520	0.28	a)
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	245'000	87'000	158'100	173'900 JPY	107.32%	186'629'480	0.21	a)
JP1200961785	2.1000 % JGB 2.1 06/20/27 96	160'000	53'000	105'050	107'950 JPY	106.65%	115'125'437	0.13	a)
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	165'000	80'000	84'200	160'800 JPY	107.40%	172'692'768	0.20	a)
JP12009817B7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/27 98	125'000	67'000	58'650	133'350 JPY	107.04%	142'731'173	0.16	a)
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	326'000	241'000	227'800	339'200 JPY	107.40%	364'304'192	0.42	a)

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 JPY	in % 7)	Kat.
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	282'000	204'000	191'850	294'150 JPY	108.16%	318'158'523	0.36	a)
JP1201011853	2.4000 % JGB 2.4 03/20/28 101	124'000	98'000	87'600	134'400 JPY	108.98%	146'469'120	0.17	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	188'000	143'000	130'400	200'600 JPY	109.41%	219'468'436	0.25	a)
JP1201031877	2.3000 % JGB 2.3 06/20/28 103	133'000	100'000	93'600	139'400 JPY	108.97%	151'908'362	0.17	a)
JP1201041884	2.1000 % JGB 2.1 06/20/28 104	121'000	85'000	83'200	122'800 JPY	108.11%	132'752'940	0.15	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	212'000	153'000	145'100	219'900 JPY	108.40%	238'360'605	0.27	a)
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	109'000	82'000	75'250	115'750 JPY	108.85%	125'997'348	0.14	a)
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	127'000	107'000	91'350	142'650 JPY	108.76%	155'150'420	0.18	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	200'000	146'000	136'800	209'200 JPY	107.80%	225'517'600	0.26	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	185'000	136'000	127'000	194'000 JPY	108.09%	209'700'420	0.24	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	253'000	202'550	200'250	255'300 JPY	109.10%	278'539'959	0.32	a)
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	145'000	106'000	99'350	151'650 JPY	110.07%	166'916'606	0.19	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	270'000	236'300	194'350	311'950 JPY	109.54%	341'703'791	0.39	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	241'000	172'000	161'650	251'350 JPY	109.91%	276'261'299	0.32	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	56'000	342'000	153'550	244'450 JPY	110.33%	269'711'463	0.31	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	151'000	70'000	75'600	145'400 JPY	110.91%	161'266'048	0.18	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	191'000	140'000	125'250	205'750 JPY	111.17%	228'732'275	0.26	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	356'000	215'000	231'550	339'450 JPY	110.57%	375'329'865	0.43	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	170'000	111'000	111'950	169'050 JPY	110.27%	186'408'054	0.21	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	149'000	97'000	102'400	143'600 JPY	109.02%	156'552'720	0.18	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	187'000	145'000	158'200	173'800 JPY	107.77%	187'307'736	0.21	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	230'000	153'000	168'750	214'250 JPY	109.91%	235'484'318	0.27	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	163'000	62'000	105'300	119'700 JPY	109.26%	130'787'811	0.15	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	319'000	406'900	315'050	410'850 JPY	111.43%	457'801'938	0.52	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	186'000	110'000	123'450	172'550 JPY	110.76%	191'112'929	0.22	a)
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	230'000	163'000	158'550	234'450 JPY	112.32%	263'322'518	0.30	a)
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	180'000	136'000	129'850	186'150 JPY	110.93%	206'498'057	0.24	a)
JP1201271B58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/31 127	177'000	72'000	98'800	150'200 JPY	110.24%	165'578'978	0.19	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	327'000	173'000	209'650	290'350 JPY	110.29%	320'227'015	0.37	a)
JP1201291B88	1.8000 % JGB 1.8 06/20/31 129	160'000	101'000	110'650	150'350 JPY	109.58%	164'747'516	0.19	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	327'000	262'900	220'100	369'800 JPY	109.67%	405'541'170	0.46	a)
JP1201311BB0	1.7000 % JGB 1.7 09/20/31 131	183'000	116'000	122'400	176'600 JPY	108.93%	192'368'614	0.22	a)
JP1201321BC7	1.7000 % JGB 1.7 12/20/31 132	256'000	194'000	160'800	289'200 JPY	109.06%	315'404'412	0.36	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	308'000	184'000	206'650	285'350 JPY	109.82%	313'368'517	0.36	a)
JP1201341C38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/32 134	267'000	207'000	207'200	266'800 JPY	109.90%	293'205'196	0.33	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	164'000	73'000	94'700	142'300 JPY	109.12%	155'273'491	0.18	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	59'000	203'000	103'500	158'500 JPY	108.34%	171'715'730	0.20	a)
JP1201371C64	1.7000 % JGB 1.7 06/20/32 137	150'000	81'000	89'500	141'500 JPY	109.18%	154'489'700	0.18	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	176'000	71'000	103'550	143'450 JPY	107.49%	154'197'274	0.18	a)
JP1201391C86	1.6000 % JGB 1.6 06/20/32 139	173'000	90'000	107'800	155'200 JPY	108.38%	168'204'208	0.19	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	480'000	423'000	433'850	469'150 JPY	109.23%	512'438'471	0.58	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	334'000	242'000	262'100	313'900 JPY	109.27%	342'989'113	0.39	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	0	267'000	116'900	150'100 JPY	110.11%	165'275'110	0.19	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	301'000	119'000	178'750	241'250 JPY	108.35%	261'401'613	0.30	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	209'000	85'000	143'650	150'350 JPY	107.49%	161'611'215	0.18	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	193'000	404'300	273'900	323'400 JPY	109.38%	353'721'984	0.40	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	280'000	335'000	257'850	357'150 JPY	109.33%	390'479'238	0.45	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	336'000	275'000	266'250	344'750 JPY	108.34%	373'515'940	0.43	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	343'000	306'000	254'150	394'850 JPY	107.31%	423'713'535	0.48	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	258'000	417'000	268'850	406'150 JPY	107.26%	435'624'306	0.50	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	408'000	394'000	321'450	480'550 JPY	106.16%	510'156'686	0.58	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	400'000	340'000	296'100	443'900 JPY	103.96%	461'456'245	0.53	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	303'000	411'000	283'350	430'650 JPY	103.81%	447'066'378	0.51	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	227'000	372'000	226'250	372'750 JPY	104.75%	390'451'898	0.45	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	348'000	345'500	282'050	411'450 JPY	103.50%	425'838'407	0.49	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	361'000	355'000	279'800	436'200 JPY	101.12%	441'085'440	0.50	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	263'000	217'000	192'550	287'450 JPY	94.00%	270'188'628	0.31	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	216'000	322'000	219'900	318'100 JPY	91.30%	290'425'300	0.33	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	362'000	376'100	260'250	477'850 JPY	94.44%	451'262'426	0.52	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	303'000	407'000	291'650	418'350 JPY	95.30%	398'695'917	0.46	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	283'000	370'000	253'000	400'000 JPY	96.09%	384'340'000	0.44	a)

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 JPY	in % 7)	Kat.
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	288'000	333'400	240'950	380'450 JPY	94.55%	359'719'280	0.41	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	374'000	403'000	306'900	470'100 JPY	94.16%	442'646'160	0.51	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	328'000	393'000	262'750	458'250 JPY	93.78%	429'723'938	0.49	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	368'000	414'000	327'650	454'350 JPY	92.05%	418'224'632	0.48	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	355'000	525'000	315'900	564'100 JPY	91.69%	517'195'085	0.59	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	284'000	439'000	259'100	463'900 JPY	93.93%	435'718'075	0.50	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	432'000	420'500	338'350	514'150 JPY	90.89%	467'305'794	0.53	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	353'000	357'000	266'850	443'150 JPY	89.03%	394'545'308	0.45	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	510'000	404'000	371'750	542'250 JPY	87.22%	472'928'760	0.54	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	455'000	310'000	318'300	446'700 JPY	86.78%	387'628'392	0.44	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	431'000	559'000	380'550	609'450 JPY	86.33%	526'150'374	0.60	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	480'000	406'000	335'300	550'700 JPY	87.33%	480'898'775	0.55	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	633'000	588'000	525'350	695'650 JPY	86.83%	604'032'895	0.69	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	665'000	518'000	462'600	720'400 JPY	86.39%	622'360'764	0.71	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	570'000	621'000	443'300	747'700 JPY	87.49%	654'125'345	0.75	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	513'000	549'600	429'700	632'900 JPY	87.05%	550'964'766	0.63	a)
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	657'000	607'200	503'100	761'100 JPY	85.11%	647'802'654	0.74	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	558'000	674'000	484'400	747'600 JPY	86.30%	645'171'324	0.74	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	657'000	635'000	493'150	798'850 JPY	85.92%	686'355'943	0.78	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	598'000	587'000	474'850	710'150 JPY	90.32%	641'386'176	0.73	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	550'000	596'000	438'000	708'000 JPY	91.61%	648'591'720	0.74	a)
JP1201821NA5	1.1000 % JGB 1.1 09/20/42 182	200'000	783'000	328'700	654'300 JPY	94.52%	618'470'532	0.71	a)
JP1201831P14	1.4000 % JGB 1.4 12/20/42 183	0	821'000	219'000	602'000 JPY	99.21%	597'238'180	0.68	a)
JP1201841P46	1.1000 % JGB 1.1 03/20/43 184	0	573'500	0	573'500 JPY	94.03%	539'273'520	0.62	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	0	687'000	0	687'000 JPY	93.63%	643'258'710	0.73	a)
JP1201861PA6	1.5000 % JGB 1 1/2 09/20/43 186	0	705'000	0	705'000 JPY	100.09%	705'620'400	0.81	a)
JP1300071253	2.3000 % JGB 2.3 05/20/32 7	96'000	61'000	62'250	94'750 JPY	114.02%	108'030'160	0.12	a)
JP13000812B5	1.8000 % JGB 1.8 11/22/32 8	91'000	96'000	89'850	97'150 JPY	110.10%	106'959'236	0.12	a)
JP1300101357	1.1000 % JGB 1.1 03/20/33 10	94'000	0	94'000	0 JPY	0.00%	0	0.00	
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	97'000	86'000	66'800	116'200 JPY	109.38%	127'094'912	0.15	a)
JP13001213B5	2.1000 % JGB 2.1 09/20/33 12	93'000	44'000	49'050	87'950 JPY	113.06%	99'431'873	0.11	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	127'000	96'000	88'150	134'850 JPY	112.15%	151'228'881	0.17	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	168'000	103'000	108'300	162'700 JPY	116.08%	188'855'652	0.22	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	195'000	150'000	135'300	209'700 JPY	117.23%	245'831'310	0.28	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	133'000	99'000	91'600	140'400 JPY	117.31%	164'708'856	0.19	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	149'000	99'000	98'200	149'800 JPY	116.43%	174'410'642	0.20	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	194'000	173'000	133'100	233'900 JPY	115.49%	270'140'466	0.31	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	136'000	95'000	91'900	139'100 JPY	115.55%	160'735'614	0.18	a)
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	136'000	101'000	93'550	143'450 JPY	117.85%	169'061'563	0.19	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	158'000	109'000	106'800	160'200 JPY	115.70%	185'354'604	0.21	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	187'000	145'000	133'200	198'800 JPY	118.05%	234'679'424	0.27	a)
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	196'000	143'000	141'750	197'250 JPY	118.10%	232'960'140	0.27	a)
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	126'000	121'000	118'300	128'700 JPY	118.07%	151'957'377	0.17	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	174'000	120'000	122'150	171'850 JPY	115.73%	198'882'005	0.23	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	303'000	271'000	214'750	359'250 JPY	116.94%	420'110'543	0.48	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	185'000	331'000	197'600	318'400 JPY	118.18%	376'278'752	0.43	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	336'000	436'350	319'700	452'650 JPY	118.21%	535'077'565	0.61	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	390'000	365'000	323'300	431'700 JPY	116.72%	503'880'240	0.58	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	384'000	514'100	377'900	520'200 JPY	115.21%	599'338'026	0.68	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	394'000	368'000	286'650	475'350 JPY	113.68%	540'377'880	0.62	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	365'000	566'000	362'100	568'900 JPY	114.90%	653'643'344	0.75	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	554'000	538'600	450'700	641'900 JPY	110.25%	707'694'750	0.81	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	492'000	407'000	366'850	532'150 JPY	113.04%	601'558'325	0.69	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	570'000	507'000	459'250	617'750 JPY	109.65%	677'381'408	0.77	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	458'000	559'000	402'500	614'500 JPY	109.35%	671'974'185	0.77	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	881'000	453'000	580'600	753'400 JPY	107.55%	810'311'836	0.92	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	264'000	408'400	254'050	418'350 JPY	105.69%	442'158'299	0.50	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	302'000	350'000	282'300	369'700 JPY	107.04%	395'726'880	0.45	a)
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	191'000	276'000	168'900	298'100 JPY	105.20%	313'604'181	0.36	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	246'000	232'000	191'100	286'900 JPY	103.26%	296'241'464	0.34	a)
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	265'000	290'400	215'000	340'400 JPY	103.12%	351'034'096	0.40	a)

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 JPY	in % 7)	Kat.
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	104'000	280'000	144'850	239'150	JPY 102.88%	246'032'737	0.28	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	229'000	220'000	162'000	287'000	JPY 102.79%	295'004'430	0.34	a)
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	172'000	147'000	120'200	198'800	JPY 99.06%	196'931'280	0.22	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	228'000	333'800	219'450	342'350	JPY 98.86%	338'443'787	0.39	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	142'000	125'000	93'050	173'950	JPY 100.49%	174'809'313	0.20	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	116'000	111'000	81'550	145'450	JPY 96.61%	140'519'245	0.16	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	163'000	126'000	119'600	169'400	JPY 96.47%	163'415'098	0.19	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	187'000	316'000	203'300	299'700	JPY 85.11%	255'059'685	0.29	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	226'000	210'000	159'200	276'800	JPY 75.49%	208'953'552	0.24	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	311'000	298'000	228'300	380'700	JPY 78.84%	300'128'652	0.34	a)
JP1300531GCO	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	183'000	224'000	161'100	245'900	JPY 80.39%	197'671'633	0.23	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	233'000	195'000	170'650	257'350	JPY 83.95%	216'035'031	0.25	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	189'000	298'000	204'350	282'650	JPY 83.58%	236'250'176	0.27	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	256'000	250'000	177'150	328'850	JPY 83.29%	273'902'454	0.31	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	247'000	305'000	220'750	331'250	JPY 83.00%	274'930'875	0.31	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	251'000	385'000	295'200	340'800	JPY 82.77%	282'086'976	0.32	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	320'000	419'200	289'200	450'000	JPY 80.46%	362'056'500	0.41	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	189'000	260'000	211'900	237'100	JPY 84.16%	199'538'618	0.23	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	325'000	284'000	239'350	369'650	JPY 79.92%	295'420'584	0.34	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	334'000	271'000	243'250	361'750	JPY 75.57%	273'378'093	0.31	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	335'000	272'000	252'050	354'950	JPY 73.25%	259'986'677	0.30	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	296'000	292'000	241'000	347'000	JPY 72.86%	252'813'790	0.29	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	319'000	454'450	311'900	461'550	JPY 72.59%	335'057'607	0.38	a)
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	383'000	305'000	285'050	402'950	JPY 72.21%	290'962'136	0.33	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	473'000	342'000	334'950	480'050	JPY 76.03%	364'986'816	0.42	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	471'000	445'000	360'400	555'600	JPY 75.79%	421'067'016	0.48	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	451'000	494'000	370'850	574'150	JPY 77.70%	446'103'067	0.51	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	474'000	401'000	350'200	524'800	JPY 77.47%	406'541'568	0.46	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	461'000	400'000	351'250	509'750	JPY 77.23%	393'679'925	0.45	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	435'000	515'450	377'800	572'650	JPY 77.00%	440'917'594	0.50	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	487'000	499'800	388'450	598'350	JPY 76.76%	459'305'427	0.52	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	292'000	591'000	353'750	529'250	JPY 83.12%	439'923'185	0.50	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	450'000	532'000	404'050	577'950	JPY 89.56%	517'623'579	0.59	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	405'000	459'000	332'750	531'250	JPY 91.76%	487'475'000	0.56	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	0	607'300	150'900	456'400	JPY 96.08%	438'499'992	0.50	a)
JP1300781P48	1.4000 % JGB 1.4 03/20/53 78	0	549'000	0	549'000	JPY 91.41%	501'862'860	0.57	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	0	555'450	0	555'450	JPY 86.86%	482'486'088	0.55	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	0	535'000	0	535'000	JPY 100.32%	536'701'300	0.61	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	131'000	93'000	90'750	133'250	JPY 114.44%	152'495'298	0.17	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	184'000	234'000	170'150	247'850	JPY 110.20%	273'133'179	0.31	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	205'000	203'000	140'850	267'150	JPY 109.90%	293'600'522	0.34	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	303'000	271'200	210'750	363'450	JPY 109.78%	398'980'872	0.46	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	290'000	309'000	224'350	374'650	JPY 105.21%	394'169'265	0.45	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	146'000	305'000	193'400	257'600	JPY 102.82%	264'854'016	0.30	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	195'000	185'000	152'450	227'550	JPY 97.81%	222'571'206	0.25	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	194'000	151'000	137'150	207'850	JPY 90.47%	188'048'131	0.21	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	359'000	434'000	303'000	490'000	JPY 65.82%	322'518'000	0.37	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	350'000	449'850	311'200	488'650	JPY 77.28%	377'604'288	0.43	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	372'000	370'000	281'550	460'450	JPY 74.07%	341'055'315	0.39	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	413'000	472'000	344'200	540'800	JPY 65.67%	355'164'992	0.41	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	607'000	700'000	491'850	815'150	JPY 64.83%	528'478'048	0.60	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	696'000	631'000	537'300	789'700	JPY 69.19%	546'393'430	0.62	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	365'000	837'200	455'100	747'100	JPY 76.23%	569'544'214	0.65	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	0	519'000	0	519'000	JPY 83.48%	433'281'960	0.49	a)
JPY							87'060'804'268	99.36	

Vermögensaufstellung

	Kurswert JPY	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	311'921'946	0.36
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	87'060'804'268	99.36
Sonstige Vermögenswerte	247'787'633	0.28

Bewertungskategorien		Kurswert JPY	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);	87'060'804'268	99.36
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0	0.00

Devisenkurse

CHF	1 = JPY	170.39692254
-----	---------	--------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	JPY	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	JPY	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA	JPY	0.00 - 0.25	-	0.093	0.00 - 0.05	-	0.013
NT	JPY	0.00 - 0.25	-	0.093	0.00 - 0.05	-	0.013
ST	JPY	0.00 - 0.25	-	0.093	0.00 - 0.05	-	0.013

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	JPY	-

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	0.200	0.500	0.100	0.100	-
NT	-	-	-	-	-
ST	-	-	-	-	-

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 Japanese 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	Ja	JPY	75.00	26.25	48.75

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	Ja	JPY	103.95	36.38	67.57
ST	Ja	JPY	97'764.04	34'217.41	63'546.63

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.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (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 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 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.
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 Garant 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^{bis} 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