

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB CHF (I)

## Jahresbericht per 29.02.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
DT CHF	11704504	CHF
GT CHF	30978860	CHF
NT CHF	11704503	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 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.



#### 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 sowie dem Fondsvertrag und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



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

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 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	11
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	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	13
11	Fussnoten	14
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	15
13	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	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'289'301'412.91	1'948'863'536.10	2'175'336'561.68	2'790'816'170.88
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'653'219.79	20'977'697.09	23'875'136.68	31'467'750.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		241'505.985	209'136.832	217'582.201	275'657.787
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		106.2219	100.3061	109.7293	114.1551
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		111.4742	100.9161	106.4833	103.8858
Thesaurierung je Anteil		0.77	0.81	0.90	1.05
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		781'051'750.00	687'273'204.48	676'589'584.79	987'875'154.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'448'021.727	7'873'650.110	7'086'874.602	9'948'193.574
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.4538	87.2878	95.4708	99.3020
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		97.0253	87.8186	92.6466	90.3688
Thesaurierung je Anteil		0.69	0.73	0.81	0.95
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.11 %	0.11 %	0.11 %	0.11 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'482'596'443.12	1'240'612'634.53	1'474'871'840.21	1'771'473'266.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'752'317.842	12'197'523.333	13'266'564.131	15'330'830.314
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		107.8070	101.7102	111.1721	115.5497
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		113.1377	102.3288	107.8834	105.1550
Thesaurierung je Anteil		0.92	0.96	1.07	1.23
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

### Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	6.19 %	7.34 %	-12.16 %	-1.86 %
Klasse GT CHF	6.22 %	7.37 %	-12.13 %	-1.83 %
Klasse NT CHF	6.34 %	7.49 %	-12.03 %	-1.72 %
Benchmark	6.18 %	7.36 %	-12.10 %	-1.82 %
Tracking Error 33)	0.07 %	0.06 %	0.11 %	0.05 %

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

## Tracking Differenz

### Klasse

Klasse DT CHF	0.01 %
Klasse GT CHF	0.04 %
Klasse NT CHF	0.16 %

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)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'465'962.91	1'417'407.06
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	2'286'387'256.89	1'945'794'577.47
Sonstige Vermögenswerte	1'518'906.79	1'712'059.79
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'289'372'126.59</b>	<b>1'948'924'044.32</b>
Andere Verbindlichkeiten	-70'713.68	-60'508.22
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'289'301'412.91</b>	<b>1'948'863'536.10</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		209'136.832	217'582.201
Ausgegebene Anteile		73'691.265	13'073.426
Zurückgenommene Anteile		-41'322.112	-21'518.795
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>241'505.985</b>	<b>209'136.832</b>

Klasse GT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'873'650.110	7'086'874.602
Ausgegebene Anteile		3'982'114.652	2'060'650.656
Zurückgenommene Anteile		-3'407'743.035	-1'273'875.148
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>8'448'021.727</b>	<b>7'873'650.110</b>

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'197'523.333	13'266'564.131
Ausgegebene Anteile		3'253'261.903	2'310'518.835
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		1'142'930.952	262'347.396
Zurückgenommene Anteile		-630'879.662	-2'200'975.157
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-2'210'518.684	-1'440'931.872
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>13'752'317.842</b>	<b>12'197'523.333</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	29.03.2023	10'957'361.33	106'997.854
Klasse NT CHF	29.03.2023	23'581'742.49	230'274.038
Klasse NT CHF	29.03.2023	5'630'722.33	54'983.603
Klasse NT CHF	30.05.2023	6'222'480.67	59'852.666
Klasse NT CHF	16.06.2023	2'490'156.15	24'132.460
Klasse NT CHF	29.11.2023	71'116'590.97	666'690.331

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	08.06.2023	114'505'274.50	1'105'259.000
Klasse NT CHF	14.06.2023	114'214'883.12	1'105'259.684

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'948'863'536.10	2'175'336'561.68
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'966'442.21	-7'287'086.45
Saldo aus dem Anteilverkehr		218'846'489.16	-37'979'520.07
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		127'557'829.86	-181'206'419.06
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'289'301'412.91</b>	<b>1'948'863'536.10</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		4'480.95	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-5'012.85
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'623.13	26'973.73
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		17'192'395.59	19'463'027.98
Erträge aus Wertpapierleihe		16.00	290.15
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		3'830'750.53	3'124'128.82
<b>Total Ertrag</b>		<b>21'029'266.20</b>	<b>22'609'407.83</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-930'208.22	-796'801.53
Ausrichtung laufende Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'239'613.50	-4'048'997.43
<b>Total Aufwand</b>		<b>-2'169'821.72</b>	<b>-4'845'798.96</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>18'859'444.48</b>	<b>17'763'608.87</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-46'810'837.64	-43'898'106.40
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		2'352'320.10	1'083'907.71
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-25'599'073.06</b>	<b>-25'050'589.82</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		153'156'902.92	-156'155'829.24
<b>Gesamterfolg</b>		<b>127'557'829.86</b>	<b>-181'206'419.06</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	186'294.14	169'932.27
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>186'294.14</b>	<b>169'932.27</b>
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	65'202.95	59'476.29
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	121'091.19	110'455.98
<b>Total</b>	<b>186'294.14</b>	<b>169'932.27</b>
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	5'898'763.57	5'777'161.13
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>5'898'763.57</b>	<b>5'777'161.13</b>
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'064'567.25	2'022'006.40
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'834'196.32	3'755'154.73
<b>Total</b>	<b>5'898'763.57</b>	<b>5'777'161.13</b>
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	12'774'386.77	11'816'515.47
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>12'774'386.77</b>	<b>11'816'515.47</b>
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'471'035.37	4'135'780.41
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'303'351.40	7'680'735.06
<b>Total</b>	<b>12'774'386.77</b>	<b>11'816'515.47</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	0	3'000	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	0	5'000	5'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239312207	1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24	0	1'150	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244175201	1.2500 % KBFRIB 1 1/4 06/03/24	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248890490	2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254147504	1.5000 % SCMNVX 1 1/2 09/28/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0268988182	1.0000 % SCMNVX 1 04/17/35	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	0	2'400	2'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0293343411	0.4000 % WKBSNW 0.4 09/15/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360677295	0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385997041	0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633260	0.0500 % GLRNKB 0.05 12/06/24	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633807	0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0410155144	0.1250 % VALIAN 0 1/8 04/23/24	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0411478099	0.4000 % KBBERN 0.4 05/03/27	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0414522273	0.1000 % KBLUZE 0.1 05/08/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041386	0.5000 % KBLUZE 0 1/2 07/26/41	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041568	0.0000 % KOROL 0 10/04/24 GMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0428194283	0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590358	0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	0	1'900	1'900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0443027047	0.1500 % KBAARG 0.15 11/15/24 0	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	0	2'800	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071270	0.1400 % KBFRI 0.14 06/12/30	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0515152483	0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521617297	0.0000 % WKBSW 0 02/14/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158820	0.4000 % KBLUZE 0.4 03/15/38	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158960	0.3126 % KBFRI 0.3126 02/02/32	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158978	0.3500 % SGKNSW 0.35 07/31/31	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158447	0.7000 % SYNINVX 0.7 12/09/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892612	0.7000 % FHZNSW 0.7 05/22/24	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	0	2'200	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591084139	0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593641068	0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1111392861	0.1000 % WKBSW 0.1 04/18/31	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011585	0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483754	0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728129	0.8500 % KBBERN 0.85 01/21/32	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	0	1'500	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151915	1.0000 % ROSW 1 02/25/37	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565761	1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1182086848	1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217750	1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	0	1'400	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367380	1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367463	1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367554	3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214912029	2.0500 % KBLUZE 2.05 09/16/47	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1217066591	2.0000 % KBL 2 02/23/34	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543838	2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937708	2.5025 % EOANGR 2.5025 12/05/29 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1230442613	1.8750 % BCG 1 7/8 12/09/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1242301278	2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243018830	3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651994	2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030131	3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
<b>CHF</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

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

							<b>2'286'387'256.89</b>	<b>99.87</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>2'286'387'256.89</b>	<b>99.87</b>	
CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	14'687'432	4'990'701	3'378'545	16'299'589 CHF	109.87	1'790'777'122.61	78.22	a)
CH0117045127	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT	4'244'737	1'541'052	1'103'241	4'682'547 CHF	105.84	495'610'134.28	21.65	a)
<b>CHF</b>							<b>2'286'387'256.89</b>	<b>99.87</b>	

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'465'962.91	0.06
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	2'286'387'256.89	99.87
Sonstige Vermögenswerte	1'518'906.79	0.07
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'289'372'126.59</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-70'713.68	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'289'301'412.91</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	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);	2'286'387'256.89	99.87
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

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

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.149	0.00 - 0.04	-	-
GT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.149	0.00 - 0.04	-	-
NT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.149	0.00 - 0.04	-	-

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

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.140	0.400	0.090	0.050	3.000
GT CHF	0.110	0.350	0.060	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000

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

## 8 Benchmark

SBI® AAA-BBB 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 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

**Ex-Datum:** 18.06.2024

**Thesaurierung an Anteilscheininhaber**

**Zahlbar:** 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	0.77138	0.26998	0.50140
GT CHF	Nein	CHF	0.69824	0.24438	0.45386
NT CHF	Nein	CHF	0.92888	0.32510	0.60378

## 11 Fussnoten

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

## 12 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 Konstanzhaltung 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 im Anhang) 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 im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses 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 Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Index Fund I

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

mit den betroffenen Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zwei Teilvermögen des Umbrella-Fonds miteinander zu vereinigen und den Fondsvertrag gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil 1 dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

In Teil 2 dieser Veröffentlichung werden zusätzlichen Fondsvertragsänderungen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

### I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

#### 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 folgende Vereinigung des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen	Übernehmendes Teilvermögen	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF	8. Februar 2024

## 2 Begründung für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Transparenz erhöht und im Interesse der Anlegerinnen und Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

## 3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 des Fondsvertrages geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die Zulässigkeit der geplanten Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist in § 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swissscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Der Fondsvertrag der zu vereinigenden Teilvermögen stimmt nach der Durchführung der in Teil II dieser Veröffentlichung beantragten Änderungen des Fondsvertrages 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.
- Die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen werden auf den gleichen Tag bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

## 4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Bst. II dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages wird mit Wirkung per 8. Februar 2024 das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anlegerinnen und Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Im Rahmen der Vereinigung werden die Anteile der Klassen DT CHF, NT CHF und XT CHF des übertragenden Teilvermögens in Anteile der neu zu eröffnenden Klassen DT CHF, NT CHF und XT CHF des übernehmenden Teilvermögens bei der Vereinigung per 8. Februar 2024 umgetauscht.

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF</b> (übernehmendes Teilvermögen)	<b>Massnahme</b>	<b>Ausführungsdatum der Massnahme</b>
DT CHF	DT CHF	Umtausch	8. Februar 2024
NT CHF	NT CHF	Umtausch	8. Februar 2024
XT CHF	XT CHF	Umtausch	8. Februar 2024

Am 9. Februar 2024 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse vom 8. Februar 2024 durchgeführt. Am 9. Februar 2024 (Bewertungstag) erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf den 8. Februar 2024.

## 5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 4. Oktober 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

## 6 Vollzug der Vereinigung

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

## 7 Kosten

Dem übertragenden Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World (übertragendes Teilvermögen)	<b>Letzter Cut Off</b> (bis 13.00 Uhr)	5. Februar 2024
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	<b>Letzter Cut Off</b> (bis 13.00 Uhr)	5. Februar 2024
	<b>Geschlossen</b> (kein Cut Off von/bis)	6. Februar bis 9. Februar 2024

## 9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

## II Änderungen im Fondsvertrag

Im Hinblick auf die Vereinigung erfolgt in der Anlagepolitik eine Angleichung der teilvermögensspezifischen Bestimmungen des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens.

In § 8 Ziff. 5 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich mittels indirekten und direkten Anlagen den Referenzindex FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index, Currency-Hedged in CHF nachbildet. Bis anhin war der FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index der massgebende Referenzindex.

Die erwähnte Angleichung in der Anlagepolitik wird nach erfolgter Vereinigung nicht mehr massgeben sein, da das übernehmende Teilvermögen infolge beantragter Anpassung der Anlagepolitik (vgl. Teil 2 dieser Veröffentlichung) die bisherige Anlagepolitik des übertragenden Teilvermögens wiederum übernehmen wird.

### Teil 2 – Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF und Anpassung in der Anlagepolitik

#### 1 Umbenennung des Teilvermögens

Die Bezeichnung des Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 3 und 6 (nach Vereinigung neue Ziff. 5), § 10 Ziff. 2, § 11 Ziff. 2, § 15 Ziff. 10 und 19, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

#### 2 Anpassung der Anlagepolitik

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird entsprechend auch der Referenzindex in § 8 Ziff. 5 des angepassten Fondsvertrages geändert. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex lautet FTSE World Broad Investment-Grade Corporate Bond Index.

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages 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 Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Fondsvertrag mit Anhang, die Jahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. November 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World**  
(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen")

und

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF**  
(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

hinsichtlich

### **Vereinigungen vom 8. Februar 2024**

Zur Bekanntgabe:

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

#### **1 Vollzug der Vereinigungen**

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 8. Februar 2024 vereinigt. Die Anlegerinnen und Anleger wurden mittels Publikation vom 27. November 2023 im Publikationsorgan der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über dessen Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 8. Februar 2024 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens auch für das übertragende Teilvermögen.

#### **2 Umtauschverhältnis**

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

##### **2.1 Berechnungsgrundlagen**

Die Anlegerinnen und Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 8. Februar 2024:

<b>Übertragendes Teilvermögen</b>			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund I	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
	DT CHF	CH0117052495	CHF 109.91
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World	NT CHF	CH0117052487	CHF 112.33
	XT CHF	CH0309788617	CHF 90.98

## Übernehmendes Teilvermögen

des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund I	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF	DT CHF	CH1300028359	CHF 109.91
	NT CHF	CH1300028367	CHF 112.33
	XT CHF	CH1300028375	CHF 90.98

## 2.2 Umtauschverhältnisse

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

## Übertragende Teilvermögen

des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund I	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World	DT CHF	1 zu 1
	NT CHF	1 zu 1
	XT CHF	1 zu 1

## 3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 23. Februar 2024 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World (übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund I») mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund I») per 8. Februar 2024 geprüft.

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

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

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss dem Fondsvertrag ordnungsgemäss durchgeführt.

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

\*\*\*

Der Fondsvertrag mit Anhang, die Jahresberichte der Teilvermögen sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Februar 2024

### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich