

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

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

Jahresbericht per 28. Februar 2022

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Collateral ausgeliehene Effekten.....	20
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I.....	20
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
Pauschale Verwaltungskommission.....	21
Benchmark.....	21
TER.....	21
Ausschüttung des Nettoertrags 2021 / 2022	21
Thesaurierung des Nettoertrags 2021 / 2022.....	22
Erklärung der Fussnoten	22
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23
Pflichtpublikationen.....	24
Bericht der Prüfgesellschaft.....	35

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 29.06.2022

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Prasident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Directbanking, Zurcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizeprasident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zurcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement
Anlage- & Vorsorgegeschaft, Zurcher Kantonalbank

Geschaftsfuhrung

Hans Frey
Geschaftsfuhrer

Andreas Hogg
stellvertretender Geschaftsfuhrer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Depotbank

Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Prufgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zurich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Vertriebstrager Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

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

Übersicht	von bis	01.03.2021 28.02.2022	01.03.2020 28.02.2021	01.03.2019 29.02.2020	01.03.2018 28.02.2019
Konsolidiert		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'162'830'461.47	1'355'262'151.66	1'290'998'463.70	1'276'168'611.49
Klasse DT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		158'806'645.64	141'864'908.07	137'948'757.25	125'504'259.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'502'985.913	1'282'677.359	1'221'523.281	1'141'117.461
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		105.6608	110.6006	112.9317	109.9836
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		102.5351	100.6511	106.2138	96.9550
Thesaurierung je Anteil		0.71	0.84	1.00	1.22
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		750'763.71	1'681'493.55	2'097'791.19	2'170'287.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'393.800	17'893.118	21'699.634	22'893.661
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		89.4426	93.9743	96.6740	94.7986
Ausschüttung je Anteil		0.60	0.60	1.00	1.00
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.18 %	0.20 %
Klasse GT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'110'081.95	7'727'799.45	19'256'729.19	58'936'302.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		32'970.130	78'274.130	191'047.944	600'464.877
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		94.3303	98.7274	100.7953	98.1511
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		91.5398	89.8459	94.7993	86.5241
Thesaurierung je Anteil		0.65	0.76	0.91	1.11
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'000'162'970.17	1'203'987'950.59	1'131'695'186.07	1'089'557'761.93
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'330'422.573	10'741'550.749	9'898'365.316	9'795'532.958
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		107.1937	112.0870	114.3315	111.2301
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		104.0227	102.0037	107.5303	98.0537
Thesaurierung je Anteil		0.90	1.02	1.19	1.41
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	YTD / 28.02.2022	2021	2020	2019
Klasse DT CHF	-3.89 %	-0.83 %	0.24 %	2.14 %
Klasse FA CHF	-3.89 %	-0.83 %	0.24 %	2.10 %
Klasse GT CHF	-3.89 %	-0.81 %	0.26 %	2.16 %
Klasse NT CHF	-3.87 %	-0.67 %	0.40 %	2.30 %
Benchmark	-3.93 %	-0.72 %	0.30 %	2.13 %
Tracking Error *	-	0.03 %	0.10 %	0.45 %

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 Error: 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)

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)

	28.02.2022	28.02.2021
Bankguthaben auf Sicht	5'282'804.41	3'187'641.91
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'153'424'592.10	1'346'771'102.50
Sonstige Vermögenswerte	4'143'197.30	5'329'233.20
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'162'850'593.81	1'355'287'977.61
Andere Verbindlichkeiten	-20'132.34	-25'825.95
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'162'830'461.47	1'355'262'151.66

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	28.02.2022	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			1'282'677.359	1'221'523.281
Ausgegebene Anteile			437'707.000	327'165.000
Zurückgenommene Anteile			-217'398.446	-266'010.922
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			1'502'985.913	1'282'677.359

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse FA CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	28.02.2022	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			17'893.118	21'699.634
Ausgegebene Anteile			3'174.000	3'034.000
Zurückgenommene Anteile			-12'673.318	-6'840.516
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			8'393.800	17'893.118

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse GT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	28.02.2022	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			78'274.130	191'047.944
Ausgegebene Anteile			17'071.000	39'010.372
Zurückgenommene Anteile			-62'375.000	-151'784.186
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			32'970.130	78'274.130

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	28.02.2022	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			10'741'550.749	9'898'365.316
Ausgegebene Anteile			1'093'822.298	1'663'648.934
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)			-	283'866.416
Zurückgenommene Anteile			-2'455'448.819	-1'044'629.917
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)			-49'501.655	-59'700.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			9'330'422.573	10'741'550.749

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)	Datum	Gegenwert	Anteile	
Klasse	NT CHF	09.12.2021	5'553'570.87	49'501.655

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	28.02.2022	28.02.2021
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			1'355'262'151.66	1'290'998'463.70
Ausbezahlte Ausschüttung			-12'453.67	-22'101.63
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-4'385'616.36	-4'663'801.03
Saldo aus dem Anteilverkehr			-137'208'122.79	89'836'983.59
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			-50'825'497.37	-20'887'392.97
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			1'162'830'461.47	1'355'262'151.66

Erfolgsrechnung	(konsolidiert)	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	28.02.2022	28.02.2021
Ertrag				
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-97'416.02	-56'282.14
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			10'758'560.74	11'717'722.26
Erträge aus Wertpapierleihe			182'291.20	228'451.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			578'567.72	1'320'683.36
Total Ertrag			11'422'003.64	13'210'574.83
Aufwand				
Reglementarische Vergütungen			-256'349.75	-233'624.19
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-1'657'609.47	-775'898.59
Total Aufwand			-1'913'959.22	-1'009'522.78
Nettoertrag / Verlust			9'508'044.42	12'201'052.05
Realisierter Erfolg				
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-4'514'023.04	-4'095'385.43
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen			557'378.34	830'419.51
Realisierter Erfolg			5'551'399.72	8'936'086.13
Nicht realisierter Erfolg				
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-56'376'897.09	-29'823'479.10
Gesamterfolg			-50'825'497.37	-20'887'392.97
Verwendung des Erfolges				
	Klasse DT CHF		28.02.2022	28.02.2021
Nettoertrag			1'069'781.02	1'077'882.70
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg			1'069'781.02	1'077'882.70
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			374'423.36	377'258.95
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage			695'357.66	700'623.75
Total			1'069'781.02	1'077'882.70
Verwendung des Erfolges				
	Klasse FA CHF		28.02.2022	28.02.2021
Nettoertrag			3'940.62	12'798.55
Vortrag des Vorjahres			2'115.64	52.96
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg			6'056.26	12'851.51
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg			5'036.28	10'735.87
Vortrag auf neue Rechnung			1'019.98	2'115.64
Total			6'056.26	12'851.51
Verwendung des Erfolges				
	Klasse GT CHF		28.02.2022	28.02.2021
Nettoertrag			21'602.14	60'242.45
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg			21'602.14	60'242.45
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			7'560.75	21'084.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage			14'041.39	39'157.59
Total			21'602.14	60'242.45
Verwendung des Erfolges				
	Klasse NT CHF		28.02.2022	28.02.2021
Nettoertrag			8'412'720.64	11'050'128.35
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg			8'412'720.64	11'050'128.35
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			2'944'452.22	3'867'544.92
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage			5'468'268.42	7'182'583.43
Total			8'412'720.64	11'050'128.35

Inventar des Fondsvermogens am Ende der Rechnungsperiode und Bestandesveranderungen wahrend der Periode

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wah- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Borse kotiert sind								1'146'332'592.10	98.58	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								1'146'332'592.10	98.58	
CH0008805449	0.0000 % IBRD 0 11/26/21	4'050	0	4'050	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	11'585	0	400	11'185	CHF	118.55 %	13'259'817.50	1.14	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	7'565	0	0	7'565	CHF	108.25 %	8'189'112.50	0.70	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	13'030	0	1'700	11'330	CHF	108.90 %	12'338'370.00	1.06	a)
CH0023960328	2.3750 % NEDWBK 2 3/8 01/27/23 EMTN	4'080	0	4'080	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0024015452	2.5000 % KA 2 1/2 02/14/22 EMTN	1'100	0	1'100	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	5'350	0	0	5'350	CHF	116.70 %	6'243'450.00	0.54	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	113.10 %	2'375'100.00	0.20	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	1'770	0	0	1'770	CHF	125.75 %	2'225'775.00	0.19	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	8'075	0	700	7'375	CHF	133.85 %	9'871'437.50	0.85	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	3'050	0	0	3'050	CHF	109.95 %	3'353'475.00	0.29	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	2'200	0	200	2'000	CHF	134.30 %	2'686'000.00	0.23	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	4'510	200	500	4'210	CHF	120.55 %	5'075'155.00	0.44	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNAV 3 3/8 08/15/31 EMTN	4'100	0	500	3'600	CHF	125.05 %	4'501'800.00	0.39	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	5'260	0	360	4'900	CHF	111.35 %	5'456'150.00	0.47	a)
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	1'865	0	0	1'865	CHF	120.90 %	2'254'785.00	0.19	a)
CH0026791225	3.1250 % C 3 1/8 09/27/21 EMTN	1'125	0	1'125	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0026950078	2.7500 % UKRAIL 2 3/4 10/06/21 EMTN	3'340	0	3'340	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	7'370	0	1'250	6'120	CHF	121.95 %	7'463'340.00	0.64	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	7'455	0	0	7'455	CHF	107.05 %	7'980'577.50	0.69	a)
CH0027815288	2.6250 % SNCF 2 5/8 12/13/21 EMTN	2'840	0	2'840	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0028608195	2.6250 % NEDWBK 2 5/8 02/07/22 EMTN	2'775	0	2'775	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'875	250	250	1'875	CHF	129.30 %	2'424'375.00	0.21	a)
CH0030876111	3.0000 % CFF 3 06/07/22 EMTN	2'910	0	2'910	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0031102061	3.0000 % OKB 3 06/14/22	2'870	0	2'870	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	2'885	0	0	2'885	CHF	107.20 %	3'092'720.00	0.27	a)
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	1'550	0	350	1'200	CHF	138.10 %	1'657'200.00	0.14	a)
CH0033037679	3.5000 % RABOBK 3 1/2 08/31/23 EMTN	2'360	0	0	2'360	CHF	105.25 %	2'483'900.00	0.21	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	3'200	0	1'000	2'200	CHF	117.60 %	2'587'200.00	0.22	a)
CH0100128351	3.0000 % EIB 3 04/14/21	2'200	0	2'200	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	2'230	0	0	2'230	CHF	107.75 %	2'402'825.00	0.21	a)
CH0107559392	2.8750 % Q 2 7/8 12/17/21 EMTN	1'710	0	1'710	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	2'550	0	550	2'000	CHF	107.60 %	2'152'000.00	0.19	a)
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	3'110	0	1'000	2'110	CHF	117.00 %	2'468'700.00	0.21	a)
CH0115457670	2.0000 % RABOBK 2 09/16/21 EMTN	2'660	0	2'660	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0115595487	2.0000 % EIB 2 08/24/22 EMTN	4'010	0	4'010	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	110.65 %	1'659'750.00	0.14	a)
CH0117615374	2.2500 % CFF 2 1/4 10/13/21 EMTN	2'480	0	2'480	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	110.00 %	1'100'000.00	0.09	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	2'350	0	0	2'350	CHF	112.55 %	2'644'925.00	0.23	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	1'830	0	500	1'330	CHF	108.45 %	1'442'385.00	0.12	a)
CH0119533278	3.1250 % CS 3 1/8 11/12/30 EMTN	1'480	0	0	1'480	CHF	114.10 %	1'688'680.00	0.15	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	2'445	0	500	1'945	CHF	108.70 %	2'114'215.00	0.18	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	2'330	0	0	2'330	CHF	117.70 %	2'742'410.00	0.24	a)
CH0125062262	2.5000 % CRH 2 1/2 03/29/21 EMTN	1'100	0	1'100	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	2'610	0	750	1'860	CHF	124.60 %	2'317'560.00	0.20	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	2'530	0	600	1'930	CHF	108.95 %	2'102'735.00	0.18	a)
CH0126516043	2.6250 % INTNED 2 5/8 03/23/21 EMTN	740	0	740	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0127860184	2.6250 % ABNAV 2 5/8 04/27/21 EMTN	1'670	0	1'670	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	103.23 %	2'064'600.00	0.18	a)
CH0129918071	2.5000 % SWEDA 2 1/2 06/03/22 EMTN	250	0	250	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0136594337	1.6250 % EBN 1 5/8 10/03/23 EMTN	2'030	0	0	2'030	CHF	103.10 %	2'092'930.00	0.18	a)

Jahresbericht per 28.02.2022

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

Valorenummer Klasse DT CHF: 11 704 513 Valorenummer Klasse GT CHF: 31 562 310

Valorenummer Klasse FA CHF: 31 562 126 Valorenummer Klasse NT CHF: 11 704 512

Rechnungswährung: CHF

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0136594386	2.0000 % PM 2 12/06/21	2'300	0	2'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	5'075	0	0	5'075	CHF	103.35 %	5'245'012.50	0.45	a)
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN	1'100	500	500	1'100	CHF	103.30 %	1'136'300.00	0.10	a)
CH0146839870	3.0000 % DGFP 3 01/24/22 EMTN	1'020	0	1'020	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	3'300	1'000	500	3'800	CHF	104.80 %	3'982'400.00	0.34	a)
CH0148937649	1.2500 % KOMINS 1 1/4 02/28/22 EMTN	2'480	0	2'480	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	2'800	1'000	600	3'200	CHF	106.30 %	3'401'600.00	0.29	a)
CH0181915585	2.7500 % SLOVAK 2 3/4 04/25/22 EMTN	2'090	0	2'090	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0181915734	1.7500 % OKB 1 3/4 05/24/23	1'550	0	0	1'550	CHF	102.73 %	1'592'315.00	0.14	a)
CH0183597266	1.6250 % CBAAU 1 5/8 05/02/22 EMTN	600	0	600	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0184777271	1.8750 % CRH 1 7/8 05/23/22 EMTN	2'100	0	2'100	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0185843015	1.1250 % EBN 1 1/8 07/04/24	1'220	0	0	1'220	CHF	102.75 %	1'253'550.00	0.11	a)
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'805	0	0	2'805	CHF	105.85 %	2'969'092.50	0.26	a)
CH0188726852	1.5000 % ABNAV 1 1/2 07/18/23 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	102.52 %	1'640'320.00	0.14	a)
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	7'105	0	800	6'305	CHF	104.00 %	6'557'200.00	0.56	a)
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	1'905	0	0	1'905	CHF	106.10 %	2'021'205.00	0.17	a)
CH0190125051	1.0000 % OKB 1 09/28/21	4'250	0	4'250	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	1'500	0	500	1'000	CHF	103.30 %	1'033'000.00	0.09	a)
CH0193040604	1.8750 % BNP 1 7/8 09/12/22 EMTN	1'750	0	1'750	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0193069835	1.1250 % BNG 1 1/8 09/13/22 EMTN	1'400	0	1'400	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0193270730	2.3750 % SOCGEN 2 3/8 09/19/22 EMTN	1'050	0	1'050	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0194405343	4.7500 % RBAIV 4 3/4 10/24/22	1'300	0	1'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0194958986	1.3750 % SHBASS 1 3/8 10/05/22 EMTN	2'200	0	2'200	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0195288193	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 EMTN	1'650	0	0	1'650	CHF	103.35 %	1'705'275.00	0.15	a)
CH0195512519	4.2500 % HVB 4 1/4 10/19/22 EMTN	790	0	790	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0196878661	1.1250 % EIB 1 1/8 04/26/23	5'540	0	1'000	4'540	CHF	101.67 %	4'615'818.00	0.40	a)
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	600	0	0	600	CHF	117.45 %	704'700.00	0.06	a)
CH0199544989	3.0000 % MQGAU 3 11/29/22 EMTN	1'940	0	1'940	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	1'300	0	1'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0203695629	0.8750 % KUNTA 0 7/8 02/01/23 EMTN	3'420	0	3'420	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	2'640	0	0	2'640	CHF	102.25 %	2'699'400.00	0.23	a)
CH0204477258	1.6250 % NAB 1 5/8 09/05/23 EMTN	3'375	0	600	2'775	CHF	102.65 %	2'848'537.50	0.24	a)
CH0204477290	1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23	3'350	0	1'250	2'100	CHF	101.83 %	2'138'430.00	0.18	a)
CH0204477308	1.7500 % ACAFP 1 3/4 03/13/23	1'350	0	0	1'350	CHF	101.98 %	1'376'730.00	0.12	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	2'950	0	500	2'450	CHF	106.55 %	2'610'475.00	0.22	a)
CH0205832618	1.1250 % Q 1 1/8 02/22/23 EMTN	2'950	0	2'950	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0206594506	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 10/16/23	1'375	0	0	1'375	CHF	103.80 %	1'427'250.00	0.12	a)
CH0207550010	1.1250 % BNG 1 1/8 04/19/23 EMTN	1'250	0	0	1'250	CHF	101.75 %	1'271'875.00	0.11	a)
CH0209654984	1.1250 % LANSBK 1 1/8 04/11/23 EMTN	1'430	500	400	1'530	CHF	101.59 %	1'554'327.00	0.13	a)
CH0209675211	1.6250 % BFCM 1 5/8 04/11/23 EMTN	950	0	0	950	CHF	101.93 %	968'335.00	0.08	a)
CH0210891989	1.1250 % NRSKTO 1 1/8 05/02/23 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	101.57 %	1'320'410.00	0.11	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	1'900	0	500	1'400	CHF	105.15 %	1'472'100.00	0.13	a)
CH0212937251	1.3750 % DBHNGR 1 3/8 07/24/23 EMTN	5'610	0	750	4'860	CHF	102.47 %	4'980'042.00	0.43	a)
CH0215278448	2.1250 % SWEMAT 2 1/8 06/26/23 GMTN	100	0	0	100	CHF	102.57 %	102'570.00	0.01	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	2'000	0	0	2'000	CHF	111.60 %	2'232'000.00	0.19	a)
CH0216320710	1.2500 % SEK 1 1/4 07/17/23 EMTN	2'450	0	0	2'450	CHF	102.37 %	2'508'065.00	0.22	a)
CH0217677654	2.2500 % ENBW 2 1/4 07/12/23 EMTN	700	0	0	700	CHF	103.01 %	721'070.00	0.06	a)
CH0220734930	3.2380 % DZBK 3.238 08/30/23 EMTN	250	0	0	250	CHF	103.85 %	259'625.00	0.02	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	4'250	0	800	3'450	CHF	103.55 %	3'572'475.00	0.31	a)
CH0226752290	2.0000 % ULFP 2 11/20/23 EMTN	700	0	0	700	CHF	103.15 %	722'050.00	0.06	a)
CH0229318131	1.8750 % CABEI 1 7/8 02/25/22 EMTN	2'150	0	2'150	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0232842341	1.5000 % Q 1 1/2 02/05/24 EMTN	2'650	0	750	1'900	CHF	103.25 %	1'961'750.00	0.17	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	3'450	0	0	3'450	CHF	104.90 %	3'619'050.00	0.31	a)
CH0233911772	1.5000 % CBAAU 1 1/2 02/07/22 EMTN	425	0	425	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	2'800	0	500	2'300	CHF	103.05 %	2'370'150.00	0.20	a)
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	500	0	0	500	CHF	103.05 %	515'250.00	0.04	a)
CH0235034110	1.1250 % ACACB 1 1/8 08/12/21 EMTN	650	0	650	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	3'850	0	750	3'100	CHF	103.85 %	3'219'350.00	0.28	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat. 8)
CH0236803992	1.0000 % COE 1 03/06/23 EMTN	2'450	0	0	2'450	CHF	101.42 %	2'484'790.00	0.21	a)
CH0238053125	1.7500 % BPLN 1 3/4 02/28/24	2'705	0	1'000	1'705	CHF	103.10 %	1'757'855.00	0.15	a)
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	104.65 %	2'093'000.00	0.18	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	2'300	0	500	1'800	CHF	104.95 %	1'889'100.00	0.16	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	4'205	250	800	3'655	CHF	103.15 %	3'770'132.50	0.32	a)
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	1'550	0	500	1'050	CHF	104.05 %	1'092'525.00	0.09	a)
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	3'195	0	1'100	2'095	CHF	102.80 %	2'153'660.00	0.19	a)
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	2'750	500	1'000	2'250	CHF	102.85 %	2'314'125.00	0.20	a)
CH0244717978	1.5000 % ELOFR 1 1/2 06/03/24 EMTN	1'350	0	0	1'350	CHF	102.00 %	1'377'000.00	0.12	a)
CH0245865834	1.0000 % NAB 1 12/10/21 GMTN	2'200	0	2'200	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0246199050	3.6380 % KTZKZ 3.638 06/20/22	1'350	0	1'350	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	9'685	0	1'500	8'185	CHF	102.05 %	8'352'792.50	0.72	a)
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	2'845	0	750	2'095	CHF	101.70 %	2'130'615.00	0.18	a)
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	2'930	0	0	2'930	CHF	102.60 %	3'006'180.00	0.26	a)
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	1'750	0	0	1'750	CHF	102.10 %	1'786'750.00	0.15	a)
CH0252511925	0.8750 % LANSBK 0 7/8 09/16/24 EMTN	2'030	0	500	1'530	CHF	102.15 %	1'562'895.00	0.13	a)
CH0253225921	0.5000 % EBN 0 1/2 09/22/22	1'625	0	1'625	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	1'400	0	0	1'400	CHF	102.65 %	1'437'100.00	0.12	a)
CH0253514753	0.6250 % BATSLN 1 5/8 09/08/21 EMTN	2'195	0	2'195	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'950	500	1'400	2'050	CHF	101.50 %	2'080'750.00	0.18	a)
CH0254282202	1.0000 % MET 1 09/19/22 0000	4'325	0	4'325	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0255590801	1.0000 % ACAFP 1 10/08/21 EMTN	850	0	850	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0255893056	1.1250 % CABEI 1 1/8 02/24/23	1'270	0	1'270	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0255893064	0.5000 % WSTP 0 1/2 02/02/22 GMTN	1'880	0	1'880	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	2'600	0	900	1'700	CHF	100.25 %	1'704'250.00	0.15	a)
CH0256886505	0.3750 % NIEDOE 0 3/8 04/27/21	2'240	0	2'240	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0256886539	0.5000 % NIEDOE 0 1/2 10/27/22	1'850	0	1'850	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	4'265	500	800	3'965	CHF	102.00 %	4'044'300.00	0.35	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	3'050	250	1'000	2'300	CHF	103.90 %	2'389'700.00	0.21	a)
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	5'150	0	0	5'150	CHF	102.85 %	5'296'775.00	0.46	a)
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	1'835	0	300	1'535	CHF	105.95 %	1'626'332.50	0.14	a)
CH0262883363	0.6250 % ACAFP 0 5/8 09/15/23 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	100.85 %	1'714'450.00	0.15	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	2'415	0	500	1'915	CHF	101.60 %	1'945'640.00	0.17	a)
CH0269836703	0.6250 % MQGAU 0 5/8 09/04/23 EMTN	3'070	0	0	3'070	CHF	101.00 %	3'100'700.00	0.27	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	4'200	0	600	3'600	CHF	92.70 %	3'337'200.00	0.29	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	10'150	0	1'400	8'750	CHF	100.80 %	8'820'000.00	0.76	a)
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	3'880	150	0	4'030	CHF	100.60 %	4'054'180.00	0.35	a)
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	8'385	0	1'000	7'385	CHF	100.80 %	7'444'080.00	0.64	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	3'850	0	0	3'850	CHF	99.90 %	3'846'150.00	0.33	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	3'020	0	1'000	2'020	CHF	102.10 %	2'062'420.00	0.18	a)
CH0276581110	0.1940 % CABEI 0.194 11/19/21 EMTN	935	0	935	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'800	0	500	1'300	CHF	99.55 %	1'294'150.00	0.11	a)
CH0278875940	0.6250 % FABUH 0 5/8 05/27/22	1'350	0	1'350	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0278875973	0.3750 % WFC 0 3/8 06/02/22 EMTN	2'750	0	2'750	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0280567469	0.3750 % BSANCI 0 3/8 05/19/22	1'450	0	1'450	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0282018974	0.7600 % SINOCH 0.76 06/17/22 EMTN	1'450	0	1'450	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	2'900	0	900	2'000	CHF	99.60 %	1'992'000.00	0.17	a)
CH0282018990	0.2500 % BZLNZ 0 1/4 06/24/22 GMTN	1'300	0	1'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	2'960	0	0	2'960	CHF	100.75 %	2'982'200.00	0.26	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	150	0	0	150	CHF	100.00 %	150'000.00	0.01	a)
CH0283726088	0.5750 % DVB 0.575 06/17/22 EMTN	1'750	0	1'750	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0284415681	0.5500 % NDASS 0.55 06/23/25 EMTN	4'550	0	1'550	3'000	CHF	100.30 %	3'009'000.00	0.26	a)
CH0285509409	0.5000 % ABNAV 0 1/2 07/29/22 EMTN	890	0	890	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	2'210	0	0	2'210	CHF	101.65 %	2'246'465.00	0.19	a)
CH0289316397	0.3500 % NAB 0.35 08/05/22 GMTN	2'450	0	2'450	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0292086193	0.4500 % CAF 0.45 09/07/23 EMTN	1'650	0	0	1'650	CHF	100.60 %	1'659'900.00	0.14	a)
CH0292086714	0.5500 % ACAFP 0.55 09/01/22 EMTN	1'050	0	1'050	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0292877880	0.3750 % RDSALN 0 3/8 08/21/23 EMTN	8'720	0	250	8'470	CHF	100.85 %	8'541'995.00	0.73	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	6'940	0	1'500	5'440	CHF	100.75 %	5'480'800.00	0.47	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	103.90 %	1'246'800.00	0.11	a)
CH0295653577	0.3000 % BNS 0.3 09/16/22 EMTN	4'680	0	4'680	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0296231951	0.3500 % NIEDOE 0.35 09/22/23	2'400	0	0	2'400	CHF	100.45 %	2'410'800.00	0.21	a)
CH0297782952	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/21/23	3'750	0	1'000	2'750	CHF	101.85 %	2'800'875.00	0.24	a)
CH0297974880	0.2500 % KO 0 1/4 12/22/22	6'100	0	6'100	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	6'600	0	500	6'100	CHF	102.00 %	6'222'000.00	0.54	a)
CH0299477353	0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN	5'150	0	0	5'150	CHF	100.40 %	5'170'600.00	0.44	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'650	0	0	2'650	CHF	100.20 %	2'655'300.00	0.23	a)
CH0302790115	0.2500 % NDASS 0 1/4 11/27/23 EMTN	3'350	0	500	2'850	CHF	100.30 %	2'858'550.00	0.25	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	99.75 %	1'695'750.00	0.15	a)
CH0303925652	0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN	2'745	0	0	2'745	CHF	100.75 %	2'765'587.50	0.24	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	99.55 %	1'991'000.00	0.17	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	3'075	0	0	3'075	CHF	99.45 %	3'058'087.50	0.26	a)
CH0305557644	0.5000 % DHR 0 1/2 12/08/23	5'135	250	0	5'385	CHF	100.80 %	5'428'080.00	0.47	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	2'900	0	1'000	1'900	CHF	101.80 %	1'934'200.00	0.17	a)
CH0306770600	0.3750 % WSTP 0 3/8 02/05/24 EMTN	4'635	0	1'000	3'635	CHF	100.40 %	3'649'540.00	0.31	a)
CH0309761853	0.2500 % NAB 0 1/4 01/19/23 GMTN	3'600	0	3'600	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0310175515	0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN	2'450	0	400	2'050	CHF	100.70 %	2'064'350.00	0.18	a)
CH0310175549	0.6500 % MDLZ 0.65 07/26/22	1'900	0	1'900	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	99.10 %	1'982'000.00	0.17	a)
CH0310451825	0.2500 % ANZNS 0 1/4 10/25/23 EMTN	2'600	0	0	2'600	CHF	100.50 %	2'613'000.00	0.22	a)
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	4'700	0	600	4'100	CHF	100.05 %	4'102'050.00	0.35	a)
CH0311427626	0.3710 % CABEI 0.371 08/26/22 EMTN	2'100	0	2'100	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	8'070	0	3'500	4'570	CHF	100.49 %	4'592'393.00	0.39	a)
CH0315593860	0.3000 % ABNANV 0.3 12/18/24 EMTN	1'350	0	350	1'000	CHF	99.80 %	998'000.00	0.09	a)
CH0315593910	0.5500 % BANQUE 0.55 10/11/22 EMTN	800	0	800	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	850	0	0	850	CHF	99.95 %	849'575.00	0.07	a)
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.00 %	1'000'000.00	0.09	a)
CH0316423265	0.3000 % NONGNO 0.3 09/16/22 EMTN	750	0	750	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0318407761	0.3500 % MINGNO 0.35 04/05/23 EMTN	2'100	0	600	1'500	CHF	100.66 %	1'509'900.00	0.13	a)
CH0319415953	0.5500 % CS 0.55 04/15/24 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	99.95 %	2'148'925.00	0.18	a)
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'400	0	400	1'000	CHF	98.55 %	985'500.00	0.08	a)
CH0320297895	0.7500 % DB 0 3/4 07/05/21 EMTN	1'450	0	1'450	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	7'040	250	2'000	5'290	CHF	100.35 %	5'308'515.00	0.46	a)
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	3'930	0	1'000	2'930	CHF	98.70 %	2'891'910.00	0.25	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'750	0	500	1'250	CHF	99.20 %	1'240'000.00	0.11	a)
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	3'195	0	0	3'195	CHF	100.20 %	3'201'390.00	0.28	a)
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'775	0	0	1'775	CHF	95.35 %	1'692'462.50	0.15	a)
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	100.77 %	2'166'555.00	0.19	a)
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	2'450	0	800	1'650	CHF	101.55 %	1'675'575.00	0.14	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	850	0	0	850	CHF	97.35 %	827'475.00	0.07	a)
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	2'050	0	0	2'050	CHF	94.60 %	1'939'300.00	0.17	a)
CH0338330449	0.1250 % VORHYP 0 1/8 10/06/21 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	4'955	0	1'000	3'955	CHF	99.75 %	3'945'112.50	0.34	a)
CH0340677779	0.1250 % HYN0E 0 1/8 10/17/23 EMTN	740	0	0	740	CHF	100.10 %	740'740.00	0.06	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	2'825	0	1'800	1'025	CHF	98.00 %	1'004'500.00	0.09	a)
CH0341440300	0.3000 % PBBGR 0.3 11/02/21 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0341725858	0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN	4'830	0	0	4'830	CHF	99.80 %	4'820'340.00	0.41	a)
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	1'400	500	1'000	900	CHF	97.80 %	880'200.00	0.08	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	5'215	500	1'500	4'215	CHF	95.45 %	4'023'217.50	0.35	a)
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	1'000	0	0	1'000	CHF	99.00 %	990'000.00	0.09	a)
CH0346461772	0.3500 % BSANCI 0.35 05/30/25 EMTN	945	0	260	685	CHF	98.75 %	676'437.50	0.06	a)
CH0346828400	2.7500 % GAZPRU 2 3/4 11/30/21	2'000	0	2'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	2'745	0	0	2'745	CHF	99.15 %	2'721'667.50	0.23	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	3'250	500	800	2'950	CHF	98.10 %	2'893'950.00	0.25	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	2'950	0	500	2'450	CHF	98.55 %	2'414'475.00	0.21	a)
CH0347556935	0.2000 % HYN0E 0.2 03/31/22 EMTN	1'300	0	1'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	2'290	0	250	2'040	CHF	99.65 %	2'032'860.00	0.17	a)
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	2'800	0	0	2'800	CHF	100.75 %	2'821'000.00	0.24	a)
CH0353945402	0.4000 % SOCGEN 0.4 02/22/22 EMTN	1'950	0	1'950	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	99.45 %	1'591'200.00	0.14	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZLNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	2'150	0	500	1'650	CHF	97.75 %	1'612'875.00	0.14	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	2'350	0	0	2'350	CHF	99.30 %	2'333'550.00	0.20	a)
CH0358181219	0.7500 % DB 0 3/4 03/21/22 EMTN	2'000	0	2'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0358654934	0.4500 % ACAFP 0.45 03/14/22 EMTN	2'000	0	2'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0359915433	1.0050 % MBKPW 1.005 03/28/23 EMTN	2'450	0	600	1'850	CHF	100.54 %	1'859'990.00	0.16	a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	1'050	0	0	1'050	CHF	100.75 %	1'057'875.00	0.09	a)
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	1'100	500	1'000	600	CHF	97.85 %	587'100.00	0.05	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	3'500	0	0	3'500	CHF	99.55 %	3'484'250.00	0.30	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'500	900	1'000	2'400	CHF	98.65 %	2'367'600.00	0.20	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	2'050	0	550	1'500	CHF	98.50 %	1'477'500.00	0.13	a)
CH0362257997	0.5000 % RENAUL 0 1/2 04/20/22 EMTN	2'300	0	2'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'400	0	0	1'400	CHF	97.35 %	1'362'900.00	0.12	a)
CH0363645505	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN	1'550	0	0	1'550	CHF	100.60 %	1'559'300.00	0.13	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	3'050	0	0	3'050	CHF	99.50 %	3'034'750.00	0.26	a)
CH0365501508	0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN	1'650	1'000	0	2'650	CHF	100.35 %	2'659'275.00	0.23	a)
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	6'350	0	0	6'350	CHF	100.53 %	6'383'655.00	0.55	a)
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	5'050	0	850	4'200	CHF	100.75 %	4'231'500.00	0.36	a)
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	4'000	0	0	4'000	CHF	100.76 %	4'030'400.00	0.35	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	4'900	250	1'000	4'150	CHF	98.00 %	4'067'000.00	0.35	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	4'000	0	500	3'500	CHF	99.20 %	3'472'000.00	0.30	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	4'050	0	1'600	2'450	CHF	99.45 %	2'436'525.00	0.21	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	900	0	0	900	CHF	100.55 %	904'950.00	0.08	a)
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	1'800	200	0	2'000	CHF	99.25 %	1'985'000.00	0.17	a)
CH0373314894	0.1250 % WSTP 0 1/8 12/15/22 EMTN	1'750	0	1'750	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'350	0	750	1'600	CHF	98.70 %	1'579'200.00	0.14	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'900	0	0	2'900	CHF	94.55 %	2'741'950.00	0.24	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	3'050	0	400	2'650	CHF	98.35 %	2'606'275.00	0.22	a)
CH0374882816	2.2500 % GAZPRU 2 1/4 07/19/22	4'800	0	4'800	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	3'200	0	0	3'200	CHF	99.65 %	3'188'800.00	0.27	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	1'900	0	0	1'900	CHF	100.15 %	1'902'850.00	0.16	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	2'400	0	500	1'900	CHF	98.50 %	1'871'500.00	0.16	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	99.50 %	1'791'000.00	0.15	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	6'250	500	750	6'000	CHF	98.75 %	5'925'000.00	0.51	a)
CH0383104343	0.5500 % NESNVX 0.55 10/04/32 EMTN	2'300	0	750	1'550	CHF	96.90 %	1'501'950.00	0.13	a)
CH0383104376	1.0500 % BCOOA 1.05 10/15/21 EMTN	500	0	500	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	1'400	0	0	1'400	CHF	99.70 %	1'395'800.00	0.12	a)
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	5'700	0	1'000	4'700	CHF	99.10 %	4'657'700.00	0.40	a)
CH0385997074	0.3000 % PKOBP 0.3 11/02/21 EMTN	2'050	0	2'050	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	3'550	0	400	3'150	CHF	97.85 %	3'082'275.00	0.27	a)
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	96.85 %	1'646'450.00	0.14	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	3'600	0	800	2'800	CHF	99.85 %	2'795'800.00	0.24	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'850	0	500	2'350	CHF	98.85 %	2'322'975.00	0.20	a)
CH0391648026	0.3750 % ADCBUH 0 3/8 01/23/23 GMTN	1'900	0	1'900	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	2'050	0	0	2'050	CHF	96.35 %	1'975'175.00	0.17	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	2'800	0	0	2'800	CHF	100.45 %	2'812'600.00	0.24	a)
CH0398677697	0.2000 % ACAFP 0.2 10/30/23 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	100.20 %	1'503'000.00	0.13	a)
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	1'810	0	0	1'810	CHF	100.35 %	1'816'335.00	0.16	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZLNZ 0.35 10/22/24 EMTN	2'300	0	0	2'300	CHF	100.15 %	2'303'450.00	0.20	a)
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'750	0	500	2'250	CHF	97.55 %	2'194'875.00	0.19	a)
CH0399198396	0.6250 % DB 0 5/8 02/08/23 EMTN	1'700	0	1'700	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0401007346	0.2530 % EIBKOR 0.253 03/06/23 EMTN	5'050	0	0	5'050	CHF	100.56 %	5'078'280.00	0.44	a)
CH0401673980	0.6250 % EBIUH 0 5/8 02/09/23 EMTN	2'900	0	2'900	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0401956831	0.5500 % BACRED 0.55 03/02/23 EMTN	2'000	0	800	1'200	CHF	100.18 %	1'202'160.00	0.10	a)
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN	1'400	0	0	1'400	CHF	100.10 %	1'401'400.00	0.12	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	1'150	0	0	1'150	CHF	100.35 %	1'154'025.00	0.10	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	2'650	0	900	1'750	CHF	99.80 %	1'746'500.00	0.15	a)
CH0401956898	0.6970 % COMQAT 0.697 03/22/21 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	1'400	0	0	1'400	CHF	99.30 %	1'390'200.00	0.12	a)
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	100.05 %	1'800'900.00	0.15	a)
CH0406415304	0.2000 % LANSBK 0.2 04/17/26 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	99.35 %	2'086'350.00	0.18	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	1'500	0	500	1'000	CHF	99.60 %	996'000.00	0.09	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	2'050	0	0	2'050	CHF	100.30 %	2'056'150.00	0.18	a)
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'750	0	750	2'000	CHF	101.30 %	2'026'000.00	0.17	a)
CH0409938120	0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.10 %	1'001'000.00	0.09	a)
CH0412528611	0.6330 % GSCCOR 0.633 01/31/24	1'000	0	0	1'000	CHF	100.45 %	1'004'500.00	0.09	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	3'815	0	800	3'015	CHF	100.20 %	3'021'030.00	0.26	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	100.35 %	1'806'300.00	0.16	a)
CH0416239777	0.5500 % RENAUL 0.55 05/30/23 EMTN	900	0	0	900	CHF	100.44 %	903'960.00	0.08	a)
CH0416445325	0.3730 % KOROIL 0.373 06/01/23 EMTN	5'670	0	800	4'870	CHF	100.70 %	4'904'090.00	0.42	a)
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	4'000	0	500	3'500	CHF	100.20 %	3'507'000.00	0.30	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	100.20 %	2'154'300.00	0.19	a)
CH0417086078	0.3030 % KDB 0.303 06/14/23 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	100.65 %	1'711'050.00	0.15	a)
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	5'150	0	1'150	4'000	CHF	99.85 %	3'994'000.00	0.34	a)
CH0418609589	0.8750 % BANORT 0 7/8 12/14/21	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0418609613	0.5650 % MBKPW 0.565 06/07/22 EMTN	1'900	0	1'900	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0418609621	0.6950 % HYUCAP 0.695 06/27/23 EMTN	4'900	0	1'500	3'400	CHF	100.70 %	3'423'800.00	0.29	a)
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	1'750	0	0	1'750	CHF	101.00 %	1'767'500.00	0.15	a)
CH0419040750	0.4000 % BFCM 0.4 02/12/24 EMTN	500	0	0	500	CHF	100.30 %	501'500.00	0.04	a)
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.85 %	998'500.00	0.09	a)
CH0419040875	0.1250 % KOWEPW 0 1/8 02/27/24 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	100.10 %	2'002'000.00	0.17	a)
CH0419040917	0.7325 % HYUCAP 0.7325 02/26/24 GMTN	3'000	0	500	2'500	CHF	100.30 %	2'507'500.00	0.22	a)
CH0419041246	0.1250 % PBBGR 0 1/8 06/05/23 EMTN	1'550	0	0	1'550	CHF	99.84 %	1'547'520.00	0.13	a)
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	99.80 %	1'796'400.00	0.15	a)
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	94.35 %	1'132'200.00	0.10	a)
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	2'400	0	0	2'400	CHF	99.05 %	2'377'200.00	0.20	a)
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	4'400	0	0	4'400	CHF	99.40 %	4'373'600.00	0.38	a)
CH0419041634	1.1950 % RURAIL 1.195 04/03/28	2'100	0	500	1'600	CHF	30.50 %	488'000.00	0.04	a)
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	2'000	0	600	1'400	CHF	95.60 %	1'338'400.00	0.12	a)
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'600	500	500	1'600	CHF	96.20 %	1'539'200.00	0.13	a)
CH0420465947	0.7500 % AMPAU 0 3/4 12/19/22 EMTN	2'300	0	2'300	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	3'700	0	500	3'200	CHF	100.60 %	3'219'200.00	0.28	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'720	0	500	1'220	CHF	99.10 %	1'209'020.00	0.10	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	4'980	0	500	4'480	CHF	100.00 %	4'480'000.00	0.39	a)
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	98.75 %	2'073'750.00	0.18	a)
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	1'950	0	850	1'100	CHF	99.50 %	1'094'500.00	0.09	a)
CH0423563532	0.1000 % RY 0.1 07/18/23 EMTN	4'050	0	0	4'050	CHF	100.36 %	4'064'580.00	0.35	a)
CH0423563540	0.2075 % KORGAS 0.2075 08/02/23 EMTN	1'530	0	0	1'530	CHF	100.55 %	1'538'415.00	0.13	a)
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	99.30 %	2'085'300.00	0.18	a)
CH0426621683	1.1250 % BACR 1 1/8 07/12/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	101.48 %	2'029'600.00	0.17	a)
CH0426621709	0.1500 % CM 0.15 07/31/23 EMTN	4'700	0	400	4'300	CHF	100.28 %	4'312'040.00	0.37	a)
CH0426621717	0.0500 % BMO 0.05 12/30/22 EMTN	5'200	0	5'200	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'900	0	400	1'500	CHF	100.25 %	1'503'750.00	0.13	a)
CH0428194291	0.4410 % BSANCI 0.441 12/21/23 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.25 %	1'002'500.00	0.09	a)
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	4'600	0	0	4'600	CHF	98.80 %	4'544'800.00	0.39	a)
CH0429659615	0.4075 % KEBHNB 0.4075 09/14/23	1'100	0	0	1'100	CHF	100.25 %	1'102'750.00	0.09	a)
CH0429659623	0.1500 % KORWAT 0.15 09/20/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	100.40 %	2'008'000.00	0.17	a)
CH0433761282	0.3225 % FABUH 0.3225 09/27/23 EMTN	2'400	0	500	1'900	CHF	100.50 %	1'909'500.00	0.16	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'950	0	550	1'400	CHF	99.35 %	1'390'900.00	0.12	a)
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	101.50 %	2'131'500.00	0.18	a)
CH0438965516	1.1150 % COMQAT 1.115 10/17/22 EMTN	1'350	0	1'350	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	1'750	500	1'050	1'200	CHF	100.05 %	1'200'600.00	0.10	a)
CH0438965540	0.6250 % SANSCF 0 5/8 10/24/22 EMTN	1'950	0	1'950	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0441004386	0.7250 % ADCBUH 0.725 02/15/24 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	101.00 %	1'515'000.00	0.13	a)
CH0441004402	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 11/15/22 EMTN	900	0	900	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	700	300	0	1'000	CHF	101.10 %	1'011'000.00	0.09	a)
CH0441186472	1.6300 % CPIPGR 1.63 10/25/23 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	102.10 %	1'837'800.00	0.16	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.00 %	1'000'000.00	0.09	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	8'850	500	0	9'350	CHF	100.20 %	9'368'700.00	0.81	a)
CH0441186522	0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	100.20 %	2'004'000.00	0.17	a)
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	1'500	0	500	1'000	CHF	100.60 %	1'006'000.00	0.09	a)
CH0446595602	0.2500 % MBGGR 0 1/4 11/14/22 EMTN	2'400	0	2'400	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	2'150	0	0	2'150	CHF	101.70 %	2'186'550.00	0.19	a)
CH0446595636	0.1250 % DNBNO 0 1/8 11/30/23 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	100.25 %	1'704'250.00	0.15	a)
CH0448036266	3.2500 % KTZKZ 3 1/4 12/05/23	1'000	0	0	1'000	CHF	94.20 %	942'000.00	0.08	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	2'500	0	500	2'000	CHF	100.00 %	2'000'000.00	0.17	a)
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'900	0	700	1'200	CHF	99.10 %	1'189'200.00	0.10	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	3'800	400	0	4'200	CHF	99.25 %	4'168'500.00	0.36	a)
CH0457206842	0.0010 % MUNHYP 0.001 02/19/24 EMTN	2'000	0	400	1'600	CHF	100.15 %	1'602'400.00	0.14	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	4'250	0	750	3'500	CHF	99.50 %	3'482'500.00	0.30	a)
CH0459297419	0.5000 % BPCEGP 0 1/2 11/08/23 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.85 %	998'500.00	0.09	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	2'350	500	1'640	1'210	CHF	103.15 %	1'248'115.00	0.11	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	3'050	500	1'000	2'550	CHF	97.90 %	2'496'450.00	0.21	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	2'150	0	250	1'900	CHF	98.00 %	1'862'000.00	0.16	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	98.10 %	1'275'300.00	0.11	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	2'700	0	500	2'200	CHF	99.35 %	2'185'700.00	0.19	a)
CH0461238872	1.5000 % BOSUH 1 1/2 11/29/23 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.00 %	990'000.00	0.09	a)
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	800	250	0	1'050	CHF	99.30 %	1'042'650.00	0.09	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	1'440	0	0	1'440	CHF	97.15 %	1'398'960.00	0.12	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	1'200	0	0	1'200	CHF	93.50 %	1'122'000.00	0.10	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	1'700	0	150	1'550	CHF	90.60 %	1'404'300.00	0.12	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	4'050	0	1'050	3'000	CHF	94.80 %	2'844'000.00	0.24	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	1'150	250	0	1'400	CHF	99.55 %	1'393'700.00	0.12	a)
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	95.85 %	1'150'200.00	0.10	a)
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	99.70 %	2'093'700.00	0.18	a)
CH0463112075	0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN	1600	0	0	1'600	CHF	99.85 %	1'597'600.00	0.14	a)
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	100.30 %	2'106'300.00	0.18	a)
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	3'100	0	0	3'100	CHF	100.50 %	3'115'500.00	0.27	a)
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	3'900	0	400	3'500	CHF	101.20 %	3'542'000.00	0.30	a)
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	2'600	0	500	2'100	CHF	100.15 %	2'103'150.00	0.18	a)
CH0465044698	1.0000 % TANNER 1 12/03/21	500	0	500	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0465347661	1.6250 % DB 1 5/8 09/12/22 EMTN	1'625	0	1'625	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	2'000	0	600	1'400	CHF	100.30 %	1'404'200.00	0.12	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	2'300	0	750	1'550	CHF	99.45 %	1'541'475.00	0.13	a)
CH0465767793	0.0000 % KORGAS 0 11/28/23	4'000	0	1'000	3'000	CHF	100.10 %	3'003'000.00	0.26	a)
CH0467182397	1.5500 % BANORT 1.55 10/11/22	2'100	0	2'100	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	3'900	0	1'000	2'900	CHF	97.90 %	2'839'100.00	0.24	a)
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	2'700	0	500	2'200	CHF	98.10 %	2'158'200.00	0.19	a)
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	99.00 %	2'079'000.00	0.18	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	3'200	0	0	3'200	CHF	98.85 %	3'163'200.00	0.27	a)
CH0467182454	1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	98.70 %	1'184'400.00	0.10	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	7'600	0	450	7'150	CHF	97.85 %	6'996'275.00	0.60	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	96.65 %	1'933'000.00	0.17	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	99.50 %	1'691'500.00	0.15	a)
CH0472691408	0.8000 % AMPAU 0.8 07/18/23 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	98.52 %	1'477'800.00	0.13	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'800	250	1'250	800	CHF	96.75 %	774'000.00	0.07	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	1'150	0	0	1'150	CHF	99.85 %	1'148'275.00	0.10	a)
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	99.05 %	1'188'600.00	0.10	a)
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	98.85 %	1'581'600.00	0.14	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	4'750	0	800	3'950	CHF	98.40 %	3'886'800.00	0.33	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	98.20 %	1'571'200.00	0.14	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0474977912	0.6250 % DANBNK 0 5/8 11/24/22 EMTN	1'400	0	1'400	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	1'000	0	0	1'000	CHF	98.95 %	989'500.00	0.09	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'400	0	0	1'400	CHF	98.35 %	1'376'900.00	0.12	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	1'300	0	750	550	CHF	97.80 %	537'900.00	0.05	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	2'940	0	0	2'940	CHF	96.35 %	2'832'690.00	0.24	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'750	0	300	1'450	CHF	95.40 %	1'383'300.00	0.12	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	2'800	0	800	2'000	CHF	96.00 %	1'920'000.00	0.17	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	2'900	500	900	2'500	CHF	95.70 %	2'392'500.00	0.21	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	2'450	0	300	2'150	CHF	94.95 %	2'041'425.00	0.18	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'600	0	0	2'600	CHF	96.40 %	2'506'400.00	0.22	a)
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'600	0	300	2'300	CHF	96.70 %	2'224'100.00	0.19	a)
CH0482172415	0.5700 % GYCGR 0.57 06/24/24 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	100.10 %	1'801'800.00	0.15	a)
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	100.30 %	1'303'900.00	0.11	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	4'600	0	400	4'200	CHF	99.20 %	4'166'400.00	0.36	a)
CH0483180961	0.6250 % ORAFP 0 5/8 06/22/29 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	99.00 %	1'287'000.00	0.11	a)
CH0485445958	0.0000 % KOHNPW 0 07/19/24 EMTN	2'200	0	0	2'200	CHF	99.75 %	2'194'500.00	0.19	a)
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	1'400	0	500	900	CHF	96.90 %	872'100.00	0.07	a)
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	3'350	0	0	3'350	CHF	99.65 %	3'338'275.00	0.29	a)
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	2'045	0	0	2'045	CHF	95.25 %	1'947'862.50	0.17	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	2'860	0	400	2'460	CHF	93.20 %	2'292'720.00	0.20	a)
CH0488506699	0.1250 % NWG 0 1/8 09/13/23 EMTN	3'000	200	0	3'200	CHF	99.45 %	3'182'400.00	0.27	a)
CH0494734343	0.4500 % BANORT 0.45 12/18/23	1'800	0	0	1'800	CHF	98.75 %	1'777'500.00	0.15	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'300	0	0	2'300	CHF	98.00 %	2'254'000.00	0.19	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	1'400	0	400	1'000	CHF	91.30 %	913'000.00	0.08	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	1'250	0	250	1'000	CHF	90.60 %	906'000.00	0.08	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	5'100	0	1'600	3'500	CHF	96.15 %	3'365'250.00	0.29	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	95.05 %	1'140'600.00	0.10	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	2'400	0	600	1'800	CHF	95.35 %	1'716'300.00	0.15	a)
CH0502393371	0.3800 % COMQAT 0.38 10/19/23 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	100.30 %	1'604'800.00	0.14	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	97.55 %	1'170'600.00	0.10	a)
CH0503144393	0.2500 % BFCM 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'350	0	350	1'000	CHF	94.30 %	943'000.00	0.08	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	4'700	0	500	4'200	CHF	93.00 %	3'906'000.00	0.34	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	98.05 %	1'568'800.00	0.13	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'450	150	500	2'100	CHF	95.30 %	2'001'300.00	0.17	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	94.05 %	940'500.00	0.08	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	2'000	400	400	2'000	CHF	94.90 %	1'898'000.00	0.16	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	1'700	250	1'050	900	CHF	95.95 %	863'550.00	0.07	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'200	0	0	1'200	CHF	98.85 %	1'186'200.00	0.10	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	95.90 %	959'000.00	0.08	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	99.05 %	1'683'850.00	0.14	a)
CH0508785737	0.1500 % SANSCF 0.15 12/10/24 EMTN	2'100	0	0	2'100	CHF	99.15 %	2'082'150.00	0.18	a)
CH0511762038	0.5225 % AFRFIN 0.5225 12/20/23 EMTN	2'200	0	0	2'200	CHF	98.85 %	2'174'700.00	0.19	a)
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'150	500	650	2'000	CHF	93.40 %	1'868'000.00	0.16	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	4'550	0	1'000	3'550	CHF	93.60 %	3'322'800.00	0.29	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	2'050	0	500	1'550	CHF	94.80 %	1'469'400.00	0.13	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	2'300	0	600	1'700	CHF	95.15 %	1'617'550.00	0.14	a)
CH0517825300	0.6000 % TANNER 0.6 11/07/22	1'710	0	1'710	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	3'215	0	0	3'215	CHF	98.25 %	3'158'737.50	0.27	a)
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	3'000	0	700	2'300	CHF	93.90 %	2'159'700.00	0.19	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	3'400	0	1'000	2'400	CHF	96.40 %	2'313'600.00	0.20	a)
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	98.50 %	1'970'000.00	0.17	a)
CH0520663664	0.5000 % BANORT 0 1/2 12/06/24	2'150	200	0	2'350	CHF	97.80 %	2'298'300.00	0.20	a)
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	4'150	0	850	3'300	CHF	93.65 %	3'090'450.00	0.27	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	2'600	0	1'000	1'600	CHF	93.55 %	1'496'800.00	0.13	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	3'000	0	1'000	2'000	CHF	93.60 %	1'872'000.00	0.16	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	0	1'350	0	1'350	CHF	95.55 %	1'289'925.00	0.11	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	0	4'050	550	3'500	CHF	93.15 %	3'260'250.00	0.28	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	0	2'000	400	1'600	CHF	97.65 %	1'562'400.00	0.13	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	2'400	0	400	2'000	CHF	95.75 %	1'915'000.00	0.16	a)
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	2'350	0	500	1'850	CHF	95.45 %	1'765'825.00	0.15	a)
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	1'300	0	0	1'300	CHF	92.80 %	1'206'400.00	0.10	a)
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	1'150	0	0	1'150	CHF	98.75 %	1'135'625.00	0.10	a)
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	95.20 %	952'000.00	0.08	a)
CH0537261874	0.1000 % CM 0.1 10/24/23 EMTN	5'600	0	0	5'600	CHF	100.60 %	5'633'600.00	0.48	a)
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	3'250	250	0	3'500	CHF	100.40 %	3'514'000.00	0.30	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'200	500	0	2'700	CHF	100.45 %	2'712'150.00	0.23	a)
CH0541537996	0.2725 % HENKEL 0.2725 04/28/23 EMTN	3'000	0	0	3'000	CHF	100.69 %	3'020'700.00	0.26	a)
CH0543827197	0.1700 % UBS 0.17 05/13/22	500	0	500	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	1'600	0	800	800	CHF	99.55 %	796'400.00	0.07	a)
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	1'800	0	1'300	500	CHF	98.60 %	493'000.00	0.04	a)
CH0545766534	0.1250 % NDASS 0 1/8 06/02/26 EMTN	2'500	0	500	2'000	CHF	98.15 %	1'963'000.00	0.17	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'400	0	0	1'400	CHF	96.50 %	1'351'000.00	0.12	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	1'800	0	250	1'550	CHF	95.00 %	1'472'500.00	0.13	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	900	100	0	1'000	CHF	99.55 %	995'500.00	0.09	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	2'040	0	500	1'540	CHF	100.20 %	1'543'080.00	0.13	a)
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	3'820	0	600	3'220	CHF	96.45 %	3'105'690.00	0.27	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	1'800	0	0	1'800	CHF	98.10 %	1'765'800.00	0.15	a)
CH0551990713	0.7525 % HYUCAP 0.7525 07/06/23 GMTN	2'000	1'000	0	3'000	CHF	100.80 %	3'024'000.00	0.26	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	3'850	250	0	4'100	CHF	100.55 %	4'122'550.00	0.35	a)
CH0554992070	0.2625 % KOROil 0.2625 07/30/27 EMTN	3'100	0	0	3'100	CHF	98.25 %	3'045'750.00	0.26	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	1'700	0	0	1'700	CHF	99.20 %	1'686'400.00	0.15	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	3'100	500	500	3'100	CHF	95.65 %	2'965'150.00	0.25	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	2'200	800	800	2'200	CHF	96.20 %	2'116'400.00	0.18	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	4'850	0	1'100	3'750	CHF	94.90 %	3'558'750.00	0.31	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	3'300	0	800	2'500	CHF	99.00 %	2'475'000.00	0.21	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	3'600	0	1'000	2'600	CHF	94.80 %	2'464'800.00	0.21	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	2'100	0	500	1'600	CHF	101.80 %	1'628'800.00	0.14	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	3'600	0	1'000	2'600	CHF	99.70 %	2'592'200.00	0.22	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	99.90 %	1'598'400.00	0.14	a)
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	2'300	0	0	2'300	CHF	95.85 %	2'204'550.00	0.19	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	5'700	0	1'300	4'400	CHF	88.85 %	3'909'400.00	0.34	a)
CH0589031134	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 MAR	900	0	900	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	1'200	600	600	1'200	CHF	97.35 %	1'168'200.00	0.10	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'600	0	0	1'600	CHF	91.80 %	1'468'800.00	0.13	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	900	1'400	1'000	1'300	CHF	94.60 %	1'229'800.00	0.11	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'900	0	0	2'900	CHF	97.05 %	2'814'450.00	0.24	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'700	250	0	1'950	CHF	97.50 %	1'901'250.00	0.16	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	2'300	0	500	1'800	CHF	87.95 %	1'583'100.00	0.14	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	1'800	200	400	1'600	CHF	87.00 %	1'392'000.00	0.12	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	0	1'400	0	1'400	CHF	96.40 %	1'349'600.00	0.12	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	2'700	0	1'000	1'700	CHF	90.90 %	1'545'300.00	0.13	a)
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'800	0	500	1'300	CHF	92.15 %	1'197'950.00	0.10	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'700	0	500	1'200	CHF	92.55 %	1'110'600.00	0.10	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	0	2'900	650	2'250	CHF	93.65 %	2'107'125.00	0.18	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	0	2'800	0	2'800	CHF	86.85 %	2'431'800.00	0.21	a)
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	0	2'300	500	1'800	CHF	99.05 %	1'782'900.00	0.15	a)
CH11002598XX	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	0	2'000	2'000	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	0	2'100	0	2'100	CHF	93.05 %	1'954'050.00	0.17	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	0	4'900	1'000	3'900	CHF	95.55 %	3'726'450.00	0.32	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	0	4'100	1'750	2'350	CHF	93.30 %	2'192'550.00	0.19	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	0	6'000	1'300	4'700	CHF	92.00 %	4'324'000.00	0.37	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	0	2'300	300	2'000	CHF	93.55 %	1'871'000.00	0.16	a)
CH1111392978	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 JUN	0	500	500	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	0	3'000	0	3'000	CHF	92.40 %	2'772'000.00	0.24	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	0	5'500	700	4'800	CHF	93.75 %	4'500'000.00	0.39	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	0	5'700	600	5'100	CHF	94.85 %	4'837'350.00	0.42	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	0	2'600	200	2'400	CHF	96.25 %	2'310'000.00	0.20	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	0	2'400	900	1'500	CHF	95.15 %	1'427'250.00	0.12	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	0	3'200	1'200	2'000	CHF	95.85 %	1'917'000.00	0.16	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	0	1'700	0	1'700	CHF	94.70 %	1'609'900.00	0.14	a)
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	0	3'100	600	2'500	CHF	94.65 %	2'366'250.00	0.20	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	0	1'900	500	1'400	CHF	94.80 %	1'327'200.00	0.11	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	0	1'800	0	1'800	CHF	94.95 %	1'709'100.00	0.15	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	4'100	400	3'700	CHF	92.75 %	3'431'750.00	0.30	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	0	3'150	400	2'750	CHF	96.15 %	2'644'125.00	0.23	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	0	800	0	800	CHF	96.95 %	775'600.00	0.07	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	0	2'600	0	2'600	CHF	93.20 %	2'423'200.00	0.21	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	0	3'000	0	3'000	CHF	96.15 %	2'884'500.00	0.25	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	3'500	500	3'000	CHF	94.35 %	2'830'500.00	0.24	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	0	4'400	1'500	2'900	CHF	92.00 %	2'668'000.00	0.23	a)
CH1122290229	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 AUG	0	800	800	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	0	1'300	400	900	CHF	87.30 %	785'700.00	0.07	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	0	3'000	0	3'000	CHF	95.65 %	2'869'500.00	0.25	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	0	2'000	0	2'000	CHF	90.55 %	1'811'000.00	0.16	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	0	1'800	0	1'800	CHF	94.75 %	1'705'500.00	0.15	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	0	1'800	0	1'800	CHF	94.35 %	1'698'300.00	0.15	a)
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	0	800	0	800	CHF	94.25 %	754'000.00	0.06	a)
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	0	3'100	500	2'600	CHF	90.00 %	2'340'000.00	0.20	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	0	2'600	0	2'600	CHF	93.85 %	2'440'100.00	0.21	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	0	2'600	600	2'000	CHF	92.00 %	1'840'000.00	0.16	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	0	2'500	0	2'500	CHF	95.90 %	2'397'500.00	0.21	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	0	2'800	500	2'300	CHF	94.35 %	2'170'050.00	0.19	a)
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	0	1'900	0	1'900	CHF	94.70 %	1'799'300.00	0.15	a)
CH1137122789	1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN	0	1'600	0	1'600	CHF	97.80 %	1'564'800.00	0.13	a)
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	0	3'350	250	3'100	CHF	95.20 %	2'951'200.00	0.25	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	0	1'200	0	1'200	CHF	96.20 %	1'154'400.00	0.10	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	0	4'000	700	3'300	CHF	95.20 %	3'141'600.00	0.27	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	0	1'100	0	1'100	CHF	96.95 %	1'066'450.00	0.09	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	0	3'600	500	3'100	CHF	93.25 %	2'890'750.00	0.25	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	0	2'400	0	2'400	CHF	95.15 %	2'283'600.00	0.20	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	0	1'200	0	1'200	CHF	97.75 %	1'173'000.00	0.10	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	0	2'300	0	2'300	CHF	98.30 %	2'260'900.00	0.19	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	0	2'200	0	2'200	CHF	96.75 %	2'128'500.00	0.18	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	0	2'400	0	2'400	CHF	97.60 %	2'342'400.00	0.20	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	0	2'200	0	2'200	CHF	96.45 %	2'121'900.00	0.18	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	0	2'200	0	2'200	CHF	96.90 %	2'131'800.00	0.18	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	0	1'700	0	1'700	CHF	96.10 %	1'633'700.00	0.14	a)
CH1142754295	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 DEC	0	600	600	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	0	1'900	1'400	500	CHF	95.10 %	475'500.00	0.04	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	0	3'900	0	3'900	CHF	93.90 %	3'662'100.00	0.31	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	0	3'400	400	3'000	CHF	95.75 %	2'872'500.00	0.25	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	0	3'200	0	3'200	CHF	93.75 %	3'000'000.00	0.26	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	0	2'400	500	1'900	CHF	97.60 %	1'854'400.00	0.16	a)
CH1146382457	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 NOV	0	800	800	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	0	2'600	0	2'600	CHF	95.90 %	2'493'400.00	0.21	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	0	1'400	0	1'400	CHF	94.10 %	1'317'400.00	0.11	a)
CH1148266237	0.3500 % BSTDBK 0.35 03/15/27 EMTN	0	2'000	0	2'000	CHF	70.05 %	1'401'000.00	0.12	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	0	1'800	0	1'800	CHF	96.04 %	1'728'666.00	0.15	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	0	2'200	0	2'200	CHF	94.25 %	2'073'500.00	0.18	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	0	2'900	0	2'900	CHF	96.55 %	2'799'950.00	0.24	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	0	2'300	0	2'300	CHF	94.60 %	2'175'800.00	0.19	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	0	3'400	0	3'400	CHF	97.48 %	3'314'456.00	0.29	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	0	3'100	0	3'100	CHF	99.18 %	3'074'704.00	0.26	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	0	1'400	0	1'400	CHF	95.55 %	1'337'700.00	0.12	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	0	2'200	0	2'200	CHF	95.40 %	2'098'778.00	0.18	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	0	1'500	0	1'500	CHF	97.35 %	1'460'250.00	0.13	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	0	1'800	0	1'800	CHF	94.85 %	1'707'300.00	0.15	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	0	1'800	0	1'800	CHF	97.03 %	1'746'450.00	0.15	a)
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	95.33 %	953'250.00	0.08	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	0	1'180	0	1'180	CHF	99.23 %	1'170'878.60	0.10	a)
CH1160382953	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26 MAR	0	600	0	600	CHF	100.00 %	600'000.00	0.05	a)
CH1160382961	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26 MAR	0	300	0	300	CHF	98.65 %	295'950.00	0.03	a)
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	0	2'100	0	2'100	CHF	98.59 %	2'070'369.00	0.18	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	0	1'400	0	1'400	CHF	98.78 %	1'382'948.00	0.12	a)
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	0	1'100	0	1'100	CHF	99.99 %	1'099'901.00	0.09	a)
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	0	1'100	0	1'100	CHF	100.06 %	1'100'649.00	0.09	a)

CHF **1'146'332'592.10** **98.58**

Nicht kotierte Wertpapiere **7'092'000.00** **0.61**

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte **7'092'000.00** **0.61**

CH0379268748	2.1000 % RURAIL 2.1 10/02/23	4'500	0	0	4'500	CHF	35.00 %	1'575'000.00	0.14	c)
CH0404311711	1.4500 % GAZPRU 1.45 03/06/23	7'750	0	2'000	5'750	CHF	38.00 %	2'185'000.00	0.19	c)
CH0419041618	0.8980 % RURAIL 0.898 10/03/25	3'900	0	0	3'900	CHF	38.00 %	1'482'000.00	0.13	c)
CH0505011962	0.4500 % BSTDBK 0.45 06/13/23	1'200	0	0	1'200	CHF	75.00 %	900'000.00	0.08	c)
CH0522690715	0.8400 % RURAIL 0.84 03/12/26	3'300	0	800	2'500	CHF	38.00 %	950'000.00	0.08	c)
CH1120085688	1.5400 % GAZPRU 1.54 06/30/27 EMTN	0	5'600	0	5'600	CHF	36.00 %	2'016'000.00	0.17	a)

CHF **7'092'000.00** **0.61**

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'282'804.41	0.45
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1'153'424'592.10	99.19
Sonstige Vermögenswerte	4'143'197.30	0.36
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'162'850'593.81	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-20'132.34	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'162'830'461.47	

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);	1'146'332'592.10	98.58
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.	7'092'000.00	0.61

Die Titel mit Domizil Russland, Weissrussland und Ukraine, die unter der Bewertungskategorie c) aufgeführt sind, haben aufgrund des Konfliktes einen Preisabschlag erhalten.

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Ausgeliehene Effekten						238'496'466.00	20.51
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte						238'496'466.00	20.51
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	10'800	CHF	118.55 %	12'803'400.00	1.10	
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	7'000	CHF	108.25 %	7'577'500.00	0.65	
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	11'330	CHF	108.90 %	12'338'370.00	1.06	
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	800	CHF	116.70 %	933'600.00	0.08	
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'100	CHF	113.10 %	2'375'100.00	0.20	
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	2'000	CHF	134.30 %	2'686'000.00	0.23	
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	4'900	CHF	111.35 %	5'456'150.00	0.47	
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	500	CHF	120.90 %	604'500.00	0.05	
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	7'455	CHF	107.05 %	7'980'577.50	0.69	
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'500	CHF	129.30 %	1'939'500.00	0.17	
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	950	CHF	138.10 %	1'311'950.00	0.11	
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	2'200	CHF	117.60 %	2'587'200.00	0.22	
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	2'085	CHF	117.00 %	2'439'450.00	0.21	
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	1'500	CHF	117.70 %	1'765'500.00	0.15	
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	4'845	CHF	103.35 %	5'007'307.50	0.43	
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN	500	CHF	103.30 %	516'500.00	0.04	
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	1'500	CHF	104.80 %	1'572'000.00	0.14	
CH0181915734	1.7500 % OKB 1 3/4 05/24/23	650	CHF	102.73 %	667'745.00	0.06	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'300	CHF	105.85 %	2'434'550.00	0.21	
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	6'275	CHF	104.00 %	6'526'000.00	0.56	
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	1'500	CHF	106.10 %	1'591'500.00	0.14	
CH0196878661	1.1250 % EIB 1 1/8 04/26/23	3'040	CHF	101.67 %	3'090'768.00	0.27	
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	2'350	CHF	106.55 %	2'503'925.00	0.22	
CH0206594506	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 10/16/23	500	CHF	103.80 %	519'000.00	0.04	
CH0209675211	1.6250 % BFCM 1 5/8 04/11/23 EMTN	950	CHF	101.93 %	968'335.00	0.08	
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	2'000	CHF	111.60 %	2'232'000.00	0.19	
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	3'450	CHF	104.90 %	3'619'050.00	0.31	
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	500	CHF	103.05 %	515'250.00	0.04	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	500	CHF	103.05 %	515'250.00	0.04	
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	1'100	CHF	102.80 %	1'130'800.00	0.10	
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	500	CHF	101.70 %	508'500.00	0.04	
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'050	CHF	101.50 %	2'080'750.00	0.18	
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	500	CHF	102.00 %	510'000.00	0.04	
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	1'500	CHF	105.95 %	1'589'250.00	0.14	
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	1'000	CHF	102.10 %	1'021'000.00	0.09	
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	150	CHF	100.00 %	150'000.00	0.01	
CH0284415681	0.5500 % NDASS 0.55 06/23/25 EMTN	1'500	CHF	100.30 %	1'504'500.00	0.13	
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	5'400	CHF	100.75 %	5'440'500.00	0.47	
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	500	CHF	103.90 %	519'500.00	0.04	
CH0296231951	0.3500 % NIEDOE 0.35 09/22/23	2'400	CHF	100.45 %	2'410'800.00	0.21	
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	5'500	CHF	102.00 %	5'610'000.00	0.48	
CH0302790115	0.2500 % NDASS 0 1/4 11/27/23 EMTN	500	CHF	100.30 %	501'500.00	0.04	
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'700	CHF	99.75 %	1'695'750.00	0.15	
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	1'000	CHF	100.00 %	1'000'000.00	0.09	
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	550	CHF	98.55 %	542'025.00	0.05	
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	2'330	CHF	98.70 %	2'299'710.00	0.20	
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	500	CHF	94.60 %	473'000.00	0.04	
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	800	CHF	97.80 %	782'400.00	0.07	
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	1'000	CHF	99.00 %	990'000.00	0.09	
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	1'000	CHF	99.15 %	991'500.00	0.09	
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	1'950	CHF	98.55 %	1'921'725.00	0.17	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	1'600	CHF	99.45 %	1'591'200.00	0.14	
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	1'000	CHF	99.30 %	993'000.00	0.09	
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	4'150	CHF	98.00 %	4'067'000.00	0.35	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	2'000	CHF	99.25 %	1'985'000.00	0.17	

Jahresbericht per 28.02.2022

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

Valorenummer Klasse DT CHF: 11 704 513 Valorenummer Klasse GT CHF: 31 562 310

Valorenummer Klasse FA CHF: 31 562 126 Valorenummer Klasse NT CHF: 11 704 512

Rechnungswährung: CHF

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	3'500	CHF	98.75 %	3'456'250.00	0.30	
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	1'000	CHF	99.70 %	997'000.00	0.09	
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'500	CHF	99.10 %	4'459'500.00	0.38	
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	1'000	CHF	97.85 %	978'500.00	0.08	
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'000	CHF	98.85 %	1'977'000.00	0.17	
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	1'000	CHF	96.35 %	963'500.00	0.08	
CH0398677697	0.2000 % ACAFP 0.2 10/30/23 EMTN	1'500	CHF	100.20 %	1'503'000.00	0.13	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'250	CHF	97.55 %	2'194'875.00	0.19	
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	1'800	CHF	100.05 %	1'800'900.00	0.15	
CH0416445325	0.3730 % KORAIL 0.373 06/01/23 EMTN	2'500	CHF	100.70 %	2'517'500.00	0.22	
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'100	CHF	100.20 %	2'104'200.00	0.18	
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	1'800	CHF	99.80 %	1'796'400.00	0.15	
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	1'000	CHF	94.35 %	943'500.00	0.08	
CH0419041618	0.8980 % RURAIL 0.898 10/03/25	500	CHF	38.00 %	190'000.00	0.02	
CH0419041634	1.1950 % RURAIL 1.195 04/03/28	1'000	CHF	30.50 %	305'000.00	0.03	
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'000	CHF	96.20 %	962'000.00	0.08	
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	500	CHF	100.00 %	500'000.00	0.04	
CH0423563540	0.2075 % KORGAS 0.2075 08/02/23 EMTN	530	CHF	100.55 %	532'915.00	0.05	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	2'000	CHF	99.30 %	1'986'000.00	0.17	
CH0429659623	0.1500 % KORWAT 0.15 09/20/23 EMTN	1'000	CHF	100.40 %	1'004'000.00	0.09	
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	1'000	CHF	101.50 %	1'015'000.00	0.09	
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	1'500	CHF	100.20 %	1'503'000.00	0.13	
CH0445088385	0.5680 % BNCHIL 0.568 11/21/23	1'000	CHF	100.60 %	1'006'000.00	0.09	
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	2'000	CHF	101.70 %	2'034'000.00	0.17	
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	2'800	CHF	99.25 %	2'779'000.00	0.24	
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	1'000	CHF	103.15 %	1'031'500.00	0.09	
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	1'900	CHF	98.00 %	1'862'000.00	0.16	
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	500	CHF	97.15 %	485'750.00	0.04	
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	1'350	CHF	90.60 %	1'223'100.00	0.11	
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	500	CHF	99.70 %	498'500.00	0.04	
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	500	CHF	99.45 %	497'250.00	0.04	
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	1'500	CHF	99.00 %	1'485'000.00	0.13	
CH0467182454	1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN	1'200	CHF	98.70 %	1'184'400.00	0.10	
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'500	CHF	99.50 %	1'492'500.00	0.13	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	500	CHF	96.75 %	483'750.00	0.04	
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	400	CHF	98.35 %	393'400.00	0.03	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	550	CHF	97.80 %	537'900.00	0.05	
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	1'000	CHF	96.35 %	963'500.00	0.08	
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	1'000	CHF	94.95 %	949'500.00	0.08	
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'500	CHF	96.40 %	1'446'000.00	0.12	
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	1'625	CHF	99.20 %	1'612'000.00	0.14	
CH0494734343	0.4500 % BANORT 0.45 12/18/23	1'500	CHF	98.75 %	1'481'250.00	0.13	
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'300	CHF	98.00 %	2'254'000.00	0.19	
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	1'000	CHF	91.30 %	913'000.00	0.08	
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	500	CHF	90.60 %	453'000.00	0.04	
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	1'000	CHF	95.30 %	953'000.00	0.08	
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	1'000	CHF	94.05 %	940'500.00	0.08	
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	1'000	CHF	95.90 %	959'000.00	0.08	
CH0520663664	0.5000 % BANORT 0 1/2 12/06/24	200	CHF	97.80 %	195'600.00	0.02	
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	2'000	CHF	95.75 %	1'915'000.00	0.16	
CH0522690715	0.8400 % RURAIL 0.84 03/12/26	2'500	CHF	38.00 %	950'000.00	0.08	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	200	CHF	92.80 %	185'600.00	0.02	
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	1'000	CHF	98.75 %	987'500.00	0.08	
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	1'000	CHF	95.20 %	952'000.00	0.08	
CH0545766534	0.1250 % NDASS 0 1/8 06/02/26 EMTN	1'000	CHF	98.15 %	981'500.00	0.08	
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	1'000	CHF	95.00 %	950'000.00	0.08	
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	400	CHF	98.10 %	392'400.00	0.03	
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	1'500	CHF	99.20 %	1'488'000.00	0.13	

Jahresbericht per 28.02.2022

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

Valorenummer Klasse DT CHF: 11 704 513 Valorenummer Klasse GT CHF: 31 562 310

Valorenummer Klasse FA CHF: 31 562 126 Valorenummer Klasse NT CHF: 11 704 512

Rechnungswährung: CHF

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat. CHF
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	1'000	CHF	94.80 %	948'000.00	0.08	
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	1'300	CHF	101.80 %	1'323'400.00	0.11	
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'600	CHF	99.90 %	1'598'400.00	0.14	
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	2'300	CHF	95.85 %	2'204'550.00	0.19	
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	400	CHF	91.80 %	367'200.00	0.03	
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'000	CHF	97.50 %	975'000.00	0.08	
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'000	CHF	92.15 %	921'500.00	0.08	
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	500	CHF	93.65 %	468'250.00	0.04	
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	500	CHF	93.55 %	467'750.00	0.04	
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	1'000	CHF	92.40 %	924'000.00	0.08	
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	1'000	CHF	93.75 %	937'500.00	0.08	
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	600	CHF	96.25 %	577'500.00	0.05	
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	500	CHF	94.65 %	473'250.00	0.04	
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	500	CHF	96.15 %	480'750.00	0.04	
CH1120085688	1.5400 % GAZPRU 1.54 06/30/27 EMTN	1'500	CHF	36.00 %	540'000.00	0.05	
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	300	CHF	96.95 %	290'850.00	0.03	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	2'100	CHF	93.20 %	1'957'200.00	0.17	
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	2'000	CHF	96.15 %	1'923'000.00	0.17	
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	500	CHF	92.00 %	460'000.00	0.04	
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	500	CHF	90.00 %	450'000.00	0.04	
CH1137122789	1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN	1'600	CHF	97.80 %	1'564'800.00	0.13	
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	3'100	CHF	95.20 %	2'951'200.00	0.25	
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	500	CHF	96.90 %	484'500.00	0.04	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	800	CHF	93.75 %	750'000.00	0.06	
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	1'600	CHF	95.90 %	1'534'400.00	0.13	
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	1'000	CHF	96.55 %	965'500.00	0.08	
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	600	CHF	94.85 %	569'100.00	0.05	
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	400	CHF	98.78 %	395'128.00	0.03	
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	1'000	CHF	99.99 %	999'910.00	0.09	

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Collateral ausgeliehene Effekten

Collateral in Fondswährung	Aktien	Obligationen
266'698'214.88	33.35 %	66.65 %

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 0.00 22)

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	0.00	0.00
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	0.00	0.00

* 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.

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Ausgabespesen in % des Nettoinventar- wertes	Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Rücknahme- spesen in % des Nettoinventar- wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.03.2021 – 28.02.2022	0.00 - 0.40	0.00	0.232	0.00 - 0.00	0.00	0.000

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.

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten: 238'496'466.00

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten: 0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements: Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten soft commissions geschlossen.

Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission wird verwendet fur die Leitung, das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermogens, wie auch fur die Entschadigung der Depotbank (PAF) fur die von ihr erbrachten Dienstleistungen.

Im Geschaftsjahr effektiv belastete Satze:

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF	max. PVK p.a.	max. VK Zielfonds p.a.
DT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.16 %	0.11 %	0.05 %	0.40 %	3.00 %
FA CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.16 %	0.06 %	0.10 %	0.50 %	3.00 %
GT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.14 %	0.09 %	0.05 %	0.35 %	3.00 %
NT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	3.00 %

Gemass den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission konnen Gebuhren bzw. Entschadigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstatigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstatigkeit gilt insbesondere jede Tatigkeit 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 Gebuhren bzw. Kosten gewahren.

Benchmark

SBI® Foreign AAA-BBB TR

TER

Die TER wurde gemass «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.

Ausschuttung des Nettoertrags 2021 / 2022

Ex Datum: 22.06.2022

Zahlbar: 25.06.2022

			Ausschuttung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fahig	Wahrung	Brutto je Anteil	Abzuglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
FA CHF	Ja	CHF	0.60	0.21	0.39

Thesaurierung des Nettoertrags 2021 / 2022

Ex Datum: 22.06.2022

Zahlbar: 25.06.2022

			Thesaurierung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	0.71177	0.24911	0.46266
GT CHF	Ja	CHF	0.65520	0.22932	0.42588
NT CHF	Ja	CHF	0.90164	0.31557	0.58607

Erklärung der 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
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt

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 allfällige 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 dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionsätze 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.

Pflichtpublikationen

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts

der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

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 USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
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 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) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR
 (neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD
 (neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
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 hedged CHF
 (nachfolgend "die Teilvermögen")

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

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible sollen künftig als Zielfonds von anderen kollektiven Kapitalanlagen der Swisscanto Fondsleitung AG dienen. Die diesbezüglichen Anpassungen des Fondsvertrages werden unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung aufgeführt.

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD sollen neu nachhaltig ausgerichtet werden, was mit einer Änderung der Anlagepolitik und mit einer Änderung der Bezeichnung dieser beiden Teilvermögen verbunden ist (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfährt die Anlagepolitik in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible Anpassungen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Weiter wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. eine Bestimmung betreffend die anteilige Kürzung von Rücknahmeanträgen (Gating) aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Des Weiteren wird bei diversen Teilvermögen eine Ergänzung betreffend die Einhaltung der Aktienfonds-Kapitalbeteiligungsquote bei Investitionen in Zielfonds vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

Zudem wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate eine Anpassung betreffend den Referenzindex vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 6 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird der Hinweis wonach das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan als Zielfonds fungiert, gestrichen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 7 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

1. Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible als Zielfonds

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. dient als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlagen:

- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V);
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V);
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V);
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II) (Anlagefonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible dient als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlage:

- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF (im Umbrella-Fonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" Swisscanto (CH) Index Fund II mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Diesbezüglich werden in § 1 Ziff. 5, § 8 Ziff. 19 und Ziff. 24, § 15 Ziff. 21 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate, Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) und Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF zudem neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen dieser Teilvermögen bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführten investierenden kollektiven Kapitalanlagen, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. bzw. das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible als Zielfonds fungieren, sollen gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des jeweiligen Zielfonds erwerben können (vgl. dazu für die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des jeweiligen Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgeblichen investierenden kollektiven Kapitalanlagen, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den jeweiligen Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 21 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

2. Änderung der Anlagepolitik bezüglich Einführung einer Nachhaltigkeitspolitik sowie Anpassung der Bezeichnung bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD

2.1 Nachhaltigkeitspolitik

In § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR) bzw. in § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD) wird neu statuiert, dass der Vermögensverwalter für das jeweilige Teilvermögen das Anlageuniversum der Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR) bzw. gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD) basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance) einschränkt.

Der Vermögensverwalter stützt sich dabei auf Daten von Drittanbietern sowie auf eigene Analysen (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

Die Reduktion des Anlageuniversums erfolgt durch Ausschlüsse und durch die Identifikation von Titeln, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien schlecht abschneiden (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

Der Vermögensverwalter richtet die Portfoliokonstruktion zudem auf eine Reduktion des CO₂-Ausstosses aus (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

In § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD wird sodann auch das Ziel der Nachhaltigkeitspolitik angegeben.

Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages i.V.m. Ziff. 1.2.1 Bst. 23) des Prospektes betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages i.V.m. Ziff. 1.2.1 Bst. 24) des Prospektes betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

2.2 Bezeichnung der Teilvermögen

Infolge der Änderung der Anlagepolitik (vgl. Ausführung in vorstehender Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung) wird die Bezeichnung der Teilvermögen wie folgt geändert:

Bezeichnung bisher:	Bezeichnung neu:
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible

Die Bezeichnung der Teilvermögen wird im Fondsvertrag entsprechend angepasst (vgl. Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 6 Ziff. 4, Titel oberhalb von § 8 Ziff. 25, Titel oberhalb von § 8 Ziff. 26, § 10 Ziff. 2, § 11 Ziff. 2, § 15 Ziff. 3, § 15 Ziff. 21, § 21 Ziff. 1 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

3. Änderung der Anlagepolitik in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

In § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible), in § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible) und in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible) werden die Angaben zur Nachhaltigkeitspolitik überarbeitet (Umformulierungen und Ergänzung von Angaben zu den Zielen der Nachhaltigkeitspolitik).

In Ziff. 1.2.1 Bst. 2) des Prospektes (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible), in Ziff. 1.2.1 Bst. 10) des Prospektes (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible) und in Ziff. 1.2.1 Bst. 12) des Prospektes (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible) finden sich neu detailliertere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik (insbesondere zur angewandten Methodik, zu den verwendeten Daten und zu den massgeblichen Ausschlusskriterien).

4. Aufnahme von Gatingbestimmungen betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. wird eine neue Bestimmung aufgenommen (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages), in welcher ausgeführt wird, dass sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen im Interesse der im betreffenden Teilvermögen verbleibenden Anleger, die anteilige Kürzung aller Rücknahmeanträge (Gating) an Bewertungstagen vorbehält, an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto 15% des Fondsvermögens übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages). Dabei gilt, dass der verbleibende Teil der Rücknahmeanträge als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten ist und zu den an diesem Bewertungstag geltenden Bedingungen abgewickelt wird (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages). Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge stattfindet (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages). Zudem wird in der neu hinzugefügten Ziff. 9 von § 17 des Fondsvertrages diesbezüglich festgehalten, dass die Fondsleitung den Entscheid über die Einführung und Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mitteilt.

5. Ergänzung betreffend die Einhaltung der Aktienfonds-Kapitalbeteiligungsquote bei Investitionen in Zielfonds

Bei den nachfolgend aufgeführten Teilvermögen werden wie bisher mindestens 51% der Aktiven des jeweiligen Teilvermögens entweder direkt in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte oder in solche kollektive Kapitalanlagen, welche als Aktienfonds gemäss deutschem Steuerrecht qualifizieren (nachfolgend "Ziel-Investmentfonds"), investiert (vgl. die beim jeweiligen Teilvermögen nachfolgend angegebene Fondsvertragsbestimmung).

Neu wird im Fondsvertrag diesbezüglich darauf hingewiesen, dass für die Einhaltung der Aktienfonds-Kapitalbeteiligungsquote auf die bewertungstäglich von den Ziel-Investmentfonds veröffentlichten tatsächlichen Kapitalbeteiligungsquoten abgestellt wird (vgl. die Ergänzung in der beim jeweiligen Teilvermögen nachfolgend angegebenen Fondsvertragsbestimmung).

- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I):**
vgl. § 8 Ziff. 3 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible:**
vgl. § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland:**
vgl. § 8 Ziff. 5 des Fondsvertrages

- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH:**
vgl. § 8 Ziff. 6 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA:**
vgl. § 8 Ziff. 7 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan:**
vgl. § 8 Ziff. 8 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan:**
vgl. § 8 Ziff. 9 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada:**
vgl. § 8 Ziff. 10 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH:**
vgl. § 8 Ziff. 11 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible:**
vgl. § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages
 - **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets:**
vgl. § 8 Ziff. 13 des Fondsvertrages
- 6. Anpassung der Angaben betreffend Referenzindex beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate**

In § 8 Ziff. 20 des Fondsvertrages, in Ziff. 1.2.1.18 des Prospektes sowie in der Tabelle zum Prospekt werden die Angaben betreffend den Referenzindex des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate wie folgt angepasst:

Referenzindex bisher	Referenzindex neu
Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond ex CHF Index	Bloomberg Global Aggregate Bond ex CHF Index

7. Streichung des Hinweises betreffend Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan als Zielfonds des Teilvermögens Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World ex CH des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I)

Betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan wird der folgende Hinweis in § 8 Ziff. 8 des Fondsvertrages gelöscht:

"Dieses Teilvermögen dient auch als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World ex CH des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I) (Dachfonds). Dieser Dachfonds darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile dieses Zielfonds erwerben. Bezüglich der damit zusammenhängenden Risiken wird auf § 15 Ziff. 21 verwiesen."

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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Ziff. 1, Ziff. 2, Ziff. 3, Ziff. 4, Ziff. 5, Ziff. 6 und Ziff. 7 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt, soweit diese Änderungen Bestimmungen nach Art. 35a Abs. 1 Bst. a – g KKV betreffen. Die 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 Änderungen des Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Umbrella-Fonds in bar verlangen können. Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die "Wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger" (KIIDs) sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden. Zürich, 16. August 2021

Die Fondsleitung:
 Swisscanto Fondsleitung AG
 Zürich

Die Depotbank:
 Zürcher Kantonalbank
 Zürich

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

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 USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

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 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 CHF) Govt. hedged CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF

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 hedged CHF

(nachfolgend „die Teilvermögen“)

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Im Fondsvertrag wird neu explizit festgehalten, dass das als Dachfonds ausgestaltete Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible in Zielfonds dieses Umbrella-Fonds investiert (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Als dann erfolgen wenige Ergänzungen im Fondsvertrag im Zusammenhang mit den bereits bestehenden Möglichkeiten der Sacheinlage (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Ferner erfolgt eine Ergänzung bei den Angaben zu den Kosten für den An- und Verkauf der Anlagen, welche dem Fondsvermögen belastet werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Überdies wird die Umschreibung des Anlegerkreises der Anteilklassen C, D, G, M und N angepasst (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Abschliessend erfährt die Anlagepolitik von sechs Teilvermögen des Umbrella-Fonds in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik Anpassungen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstituts-gesetz (FINIG)) vorgenommen.

1. Investitionen eines Dachfonds in Zielfonds innerhalb des Umbrella-Funds

Es wird neu explizit festgehalten, dass das in diesem Umbrella-Fonds enthaltene Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible, welches als Dachfonds ausgestaltet ist, u.a. in die Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible dieses Umbrella-Fonds investiert (vgl. § 1 Ziff. 5., § 8 Ziff. 25 und Ziff. 26, § 15 Ziff. 21 und § 26 Ziff. 1).

2. Ergänzung Sacheinlage

Bis anhin war in § 5 Ziff. 4 des Fondsvertrages lediglich festgehalten, dass die Anleger zur Einzahlung des von ihnen gezeichneten Anteils in das entsprechende Teilvermögen verpflichtet sind. Da jedoch der Fondsvertrag grundsätzlich auch die Möglichkeit einer Sacheinlage vorsieht, erfolgt an dieser Stelle eine Ergänzung betreffend die Leistung einer Sacheinlage.

§ 5 Ziff. 4 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Anleger sind nur zur Einzahlung bzw. zur Leistung der Sacheinlage im Umfang der von ihnen gezeichneten Anteile in das entsprechende Teilvermögen verpflichtet. Ihre persönliche Haftung für Verbindlichkeiten des Umbrella-Fonds bzw. Teilvermögens ist ausgeschlossen."

3. Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen

Bei der beispielhaften Aufzählung der dem Fondsvermögen belasteten Kosten für den An- und Verkauf der Anlagen, werden neu auch die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen aufgeführt (vgl. die Ergänzung in § 20 Ziff. 2 Bst. a des Fondsvertrages).

4. Angepasster Beschrieb des Anlegerkreises bei verschiedenen Anteilklassen

Bei den im Folgenden aufgeführten Anteilklassen wird der Anlegerkreisbeschrieb geändert (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages). Der angepasste Anlegerkreisbeschrieb der massgeblichen Anteilklassen wird nachfolgend aufgeführt.

4.1 Anteilklassen C

Anteile der Anteilklassen CT, CT CHF, CT EUR, CT GBP, CT USD, CTH CHF, CTH EUR, CTH GBP, CTH USD, CA, CA CHF, CA EUR, CA GBP, CA USD, CAH CHF, CAH EUR, CAH GBP, CAH USD werden allen Anlegern angeboten, welche einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Anlageberatungsvertrag, welcher die Zulassung zu den oben genannten Anteilklassen umfasst, mit einem Kooperationspartner abgeschlossen haben. Die Anteile der oben genannten Anteilklassen können nur von Kooperationspartnern angeboten werden, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

4.2 Anteilklassen D

Anteile der Anteilklassen DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH CHF, DTH EUR, DTH GBP, DTH USD, DA, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD, DAH CHF, DAH EUR, DAH GBP, DAH USD stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) sowie Anlegern offen, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilklassen DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH CHF, DTH EUR, DTH GBP, DTH USD, DA, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD, DAH CHF, DAH EUR, DAH GBP, DAH USD stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilklassen DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH CHF, DTH EUR, DTH GBP, DTH USD, DA, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD, DAH CHF, DAH EUR, DAH GBP, DAH USD ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{ter} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Die Anteile der oben genannten Anteilklassen können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden.

4.3 Anteilsklassen G

Anteile der Anteilsklassen GT, GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GTH CHF, GTH EUR, GTH GBP, GTH USD, GA, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH CHF, GAH EUR, GAH GBP, GAH USD stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) offen, sofern diese einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Investitionsvertrag mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{er} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklassen GT, GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GTH CHF, GTH EUR, GTH GBP, GTH USD, GA, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH CHF, GAH EUR, GAH GBP, GAH USD stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilsklassen GT, GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GTH CHF, GTH EUR, GTH GBP, GTH USD, GA, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH CHF, GAH EUR, GAH GBP, GAH USD ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3^{er} KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Weitere Voraussetzung ist, dass der Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG eine Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe abgeschlossen hat.

4.4 Anteilsklassen M

Anteile der Anteilsklassen MT, MT CHF, MT EUR, MT GBP, MT USD, MTH CHF, MTH EUR, MTH GBP, MTH USD, MA, MA CHF, MA EUR, MA GBP, MA USD, MAH CHF, MAH EUR, MAH GBP, MAH USD werden nur Anlegern angeboten, die einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren individuellen Anlageberatungsvertrag mit der Zürcher Kantonalbank abgeschlossen haben, welcher die Zulassung zu den oben genannten Anteilsklassen umfasst. Die oben genannten Anteilsklassen stehen den Anlegern der Zürcher Kantonalbank nur offen, sofern die Zürcher Kantonalbank mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe eine entsprechende Kooperationsvereinbarung abgeschlossen hat.

4.5 Anteilsklassen N

Anteile der Anteilsklassen NT, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NTH CHF, NTH EUR, NTH GBP, NTH USD, NA, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH CHF, NAH EUR, NAH GBP, NAH USD werden nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) angeboten, die einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Dienstleistungsvertrag (Vermögensverwaltungsvertrag, Beratungsvertrag, Investitionsvertrag oder ein anderer Dienstleistungsvertrag) mit einem entsprechenden Kooperationspartner der Swisscanto Fondsleitung AG oder einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit der Zürcher Kantonalbank einen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag abgeschlossen haben.

Anteile der Anteilsklassen NT, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NTH CHF, NTH EUR, NTH GBP, NTH USD, NA, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH CHF, NAH EUR, NAH GBP, NAH USD stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen und keinen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag mit der Zürcher Kantonalbank abgeschlossen haben, stehen Anteile der Anteilsklassen NT, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NTH CHF, NTH EUR, NTH GBP, NTH USD, NA, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH CHF, NAH EUR, NAH GBP, NAH USD nicht zu Verfügung. Banken können die Anteile nur anbieten, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

5. Änderung der Anlagepolitik von sechs Teilvermögen in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik

Die in den nachfolgend aufgeführten Fondsvertragsbestimmungen enthaltenen Angaben zur Nachhaltigkeitspolitik des jeweiligen Teilvermögens werden überarbeitet (Umformulierungen, Präzisierungen und Ergänzung von Angaben zu den Zielen der Nachhaltigkeitspolitik):

- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages)

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible** beinhaltet Folgendes:

Für dieses Teilvermögen schränkt der Vermögensverwalter das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis d von § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität** der Anlagen im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e- Intensität** der Anlagen im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis d und h von § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine Reduktion der **CO₂e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO₂e-Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO₂e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. c von § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

In Ziff. 1.2.1 des Prospektes finden sich neu detailliertere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik der jeweiligen Teilvermögen (insbesondere zur angewandten Methodik, zu den verwendeten Daten und zu den massgeblichen Ausschlusskriterien).

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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1, Ziff. 4 und Ziff. 5 der in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 01. November 2021

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Bericht der Prüfgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V

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 USA
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- 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 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) Govt. (I)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF
- 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 hedged CHF

bestehend aus den Vermögensrechnungen und den Erfolgsrechnungen, 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) für das am 28. Februar 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnungen, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern sind. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnungen abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnungen frei von wesentlichen falschen Angaben sind.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in den Jahresrechnungen enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in den Jahresrechnungen als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnungen von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnungen. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entsprechen die Jahresrechnungen für das am 28. Februar 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestatigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhangigkeit gemass Revisionsaufsichtsgesetz erfullen und keine mit unserer Unabhangigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Zurich, 29. Juni 2022