

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

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	11704513	CHF
FA CHF	31562126	CHF
GT CHF	31562310	CHF
NT CHF	11704512	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund 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 Europe (ex CH) Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible¹
- ▶ 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 JPY/CHF) Inflation-Linked
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

¹ Erfolgsrechnungen für den Zeitraum vom 31. Oktober 2022 bis 29. Februar 2024 für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	22
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	23
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	23
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	23
8	Pauschale Verwaltungskommission	24
9	Benchmark	24
10	TER	24
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	25
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	25
13	Fussnoten	25
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	26
15	Pflichtpublikationen	28

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		987'324'918.14	1'063'840'970.80	1'162'830'461.47	1'355'262'151.66
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		36'712'353.79	147'509'277.97	158'806'645.64	141'864'908.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		352'600.723	1'480'142.913	1'502'985.913	1'282'677.359
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		104.1188	99.6588	105.6608	110.6006
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		109.2671	100.2649	102.5351	100.6511
Thesaurierung je Anteil		1.02	0.69	0.71	0.84
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'064'095.65	1'266'172.18	750'763.71	1'681'493.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'201.474	15'079.251	8'393.800	17'893.118
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87.2104	83.9678	89.4426	93.9743
Ausschüttung je Anteil		0.85	0.70	0.60	0.60
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse GT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'320'411.54	1'484'809.37	3'110'081.95	7'727'799.45
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'201.485	16'686.485	32'970.130	78'274.130
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		92.9770	88.9828	94.3303	98.7274
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		97.5744	89.5239	91.5398	89.8459
Thesaurierung je Anteil		0.92	0.63	0.65	0.76
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		948'228'057.16	913'580'711.28	1'000'162'970.17	1'203'987'950.59
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'958'900.770	9'027'207.933	9'330'422.573	10'741'550.749
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		105.8420	101.2030	107.1937	112.0870
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		111.0755	101.8185	104.0227	102.0037
Thesaurierung je Anteil		1.20	0.86	0.90	1.02
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	4.73 %	5.27 %	-9.70 %	-0.83 %
Klasse FA CHF	4.73 %	5.27 %	-9.70 %	-0.83 %
Klasse GT CHF	4.75 %	5.29 %	-9.68 %	-0.81 %
Klasse NT CHF	4.90 %	5.44 %	-9.56 %	-0.67 %
Benchmark	4.61 %	5.23 %	-9.38 %	-0.72 %
Tracking Error 33)	0.10 %	0.08 %	0.34 %	0.03 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	0.12 %
Klasse FA CHF	0.12 %
Klasse GT CHF	0.14 %
Klasse NT CHF	0.29 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	4'105'346.35	3'159'753.56
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	977'512'658.43	1'056'372'660.00
Sonstige Vermögenswerte	5'713'510.38	4'327'069.26
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	987'331'515.16	1'063'859'482.82
Andere Verbindlichkeiten	-6'597.02	-18'512.02
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	987'324'918.14	1'063'840'970.80

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'480'142.913	1'502'985.913
Ausgegebene Anteile		123'250.810	265'142.000
Zurückgenommene Anteile		-1'250'793.000	-287'985.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		352'600.723	1'480'142.913
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		15'079.251	8'393.800
Ausgegebene Anteile		1'594.695	7'354.333
Zurückgenommene Anteile		-4'472.472	-668.882
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		12'201.474	15'079.251
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'686.485	32'970.130
Ausgegebene Anteile		1'330.000	10'521.355
Zurückgenommene Anteile		-3'815.000	-26'805.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		14'201.485	16'686.485
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		9'027'207.933	9'330'422.573
Ausgegebene Anteile		1'441'705.306	801'601.473
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		18'573.851	116'727.697
Zurückgenommene Anteile		-1'036'878.265	-893'937.900
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-491'708.055	-327'605.910
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'958'900.770	9'027'207.933

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	14.03.2023	195'883.52	1'930.958
Klasse NT CHF	23.05.2023	1'699'562.25	16'642.893

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	08.06.2023	25'171'166.63	246'692.945
Klasse NT CHF	14.06.2023	24'947'095.48	245'015.110

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'063'840'970.80	1'162'830'461.47
Ausbezahlte Ausschüttung		-10'070.44	-5'756.28
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'004'307.27	-3'370'921.81
Saldo aus dem Anteilverkehr		-122'804'933.94	-32'459'975.66
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		49'303'258.99	-63'152'836.92
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		987'324'918.14	1'063'840'970.80

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		42'719.75	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-36'288.95
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		12'037'746.66	9'207'235.27
Erträge aus Wertpapierleihe		245'690.45	240'743.40
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		644'177.17	407'375.76
Total Ertrag		12'970'334.03	9'819'065.48
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-205'781.19	-244'721.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'609'624.92	-676'384.38
Total Aufwand		-1'815'406.11	-921'105.38
Nettoertrag / Verlust		11'154'927.92	8'897'960.10
Realisierter Erfolg			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-19'135'625.59	-32'294'589.41
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		586'307.64	401'369.87
Realisierter Erfolg		-7'394'390.03	-22'995'259.44
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		56'697'649.02	-40'157'577.48
Gesamterfolg		49'303'258.99	-63'152'836.92

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF			
	29.02.2024	28.02.2023	
Nettoertrag	359'965.35	1'029'363.57	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	359'965.35	1'029'363.57	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	125'987.87	360'277.25	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	233'977.48	669'086.32	
Total	359'965.35	1'029'363.57	
Klasse FA CHF			
	29.02.2024	28.02.2023	
Nettoertrag	10'426.51	9'660.04	
Vortrag des Vorjahres	124.54	1'019.98	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10'551.05	10'680.02	
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	10'371.25	10'555.48	
Vortrag auf neue Rechnung	179.80	124.54	
Total	10'551.05	10'680.02	
Klasse GT CHF			
	29.02.2024	28.02.2023	
Nettoertrag	13'203.37	10'660.76	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	13'203.37	10'660.76	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'621.18	3'731.27	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'582.19	6'929.49	
Total	13'203.37	10'660.76	
Klasse NT CHF			
	29.02.2024	28.02.2023	
Nettoertrag	10'771'332.69	7'848'275.73	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10'771'332.69	7'848'275.73	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'769'966.44	2'746'896.51	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	7'001'366.25	5'101'379.22	
Total	10'771'332.69	7'848'275.73	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							977'512'658.43	99.01	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							977'512'658.43	99.01	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	11'185	500	2'150	9'535 CHF	109.40%	10'431'290.00	1.06	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	7'165	550	1'780	5'935 CHF	101.51%	6'024'618.50	0.61	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	11'130	600	1'800	9'930 CHF	101.77%	10'105'761.00	1.02	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	5'350	0	1'900	3'450 CHF	106.40%	3'670'800.00	0.37	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	2'400	0	450	1'950 CHF	103.05%	2'009'475.00	0.20	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	1'770	600	0	2'370 CHF	113.95%	2'700'615.00	0.27	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	7'225	700	1'800	6'125 CHF	121.50%	7'441'875.00	0.75	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	2'450	450	350	2'550 CHF	101.97%	2'600'235.00	0.26	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	2'050	0	500	1'550 CHF	121.10%	1'877'050.00	0.19	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	4'210	300	600	3'910 CHF	110.15%	4'306'865.00	0.44	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNAV 3 3/8 08/15/31 EMTN	3'600	0	500	3'100 CHF	112.50%	3'487'500.00	0.35	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	4'900	0	900	4'000 CHF	103.80%	4'152'000.00	0.42	a)
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	1'615	0	315	1'300 CHF	111.15%	1'444'950.00	0.15	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	6'020	0	800	5'220 CHF	111.35%	5'812'470.00	0.59	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	7'455	0	7'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'575	0	0	1'575 CHF	115.95%	1'826'212.50	0.18	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	2'685	0	2'685	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	930	0	0	930 CHF	123.05%	1'144'365.00	0.12	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	1'900	0	0	1'900 CHF	107.75%	2'047'250.00	0.21	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	3'430	0	3'430	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	2'110	500	850	1'760 CHF	108.85%	1'915'760.00	0.19	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	1'150	0	150	1'000 CHF	102.70%	1'027'000.00	0.10	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	800	0	0	800 CHF	101.80%	814'400.00	0.08	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	1'650	0	800	850 CHF	104.30%	886'550.00	0.09	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	1'330	350	295	1'385 CHF	101.70%	1'408'545.00	0.14	a)
CH0119533278	3.1250 % UBS 3 1/8 11/12/30 EMTN	1'080	0	0	1'080 CHF	107.35%	1'159'380.00	0.12	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	1'545	250	500	1'295 CHF	101.95%	1'320'252.50	0.13	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	2'330	0	1'000	1'330 CHF	107.90%	1'435'070.00	0.15	a)
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	1'860	250	800	1'310 CHF	112.65%	1'475'715.00	0.15	a)
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	1'930	250	800	1'380 CHF	102.20%	1'410'360.00	0.14	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	3'800	0	3'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	3'200	100	200	3'100 CHF	100.85%	3'126'350.00	0.32	a)
CH0185843015	1.1250 % EBN 1 1/8 07/04/24	1'220	0	1'220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	2'605	150	850	1'905 CHF	100.35%	1'911'667.50	0.19	a)
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	6'005	0	6'005	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	1'905	0	200	1'705 CHF	100.35%	1'710'967.50	0.17	a)
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	700	0	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0195288193	1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 EMTN	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	1'400	0	300	1'100 CHF	108.10%	1'189'100.00	0.12	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	2'750	350	800	2'300 CHF	100.90%	2'320'700.00	0.24	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	1'400	0	0	1'400 CHF	100.12%	1'401'680.00	0.14	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'100	0	0	1'100 CHF	104.10%	1'145'100.00	0.12	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	3'450	250	3'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	3'100	0	3'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238053125	1.7500 % BPLN 1 3/4 02/28/24	1'555	0	1'555	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238315664	2.1250 % ACAFP 2 1/8 10/30/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	1'800	150	400	1'550 CHF	100.15%	1'552'325.00	0.16	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	3'455	0	3'455	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243069280	2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN	1'050	0	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0243069363	1.6250 % PM 1 5/8 05/16/24	2'095	0	2'095	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	2'250	0	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244717978	1.5000 % ELOFR 1 1/2 06/03/24 EMTN	950	0	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	8'185	0	8'185	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	2'095	0	2'095	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	2'930	0	2'930	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	1'530	0	1'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	900	200	0	1'100 CHF	98.60%	1'084'600.00	0.11	a)
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'050	600	570	2'080 CHF	99.20%	2'063'360.00	0.21	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	1'700	0	800	900 CHF	97.30%	875'700.00	0.09	a)
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	3'965	0	3'965	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	2'300	0	350	1'950 CHF	97.85%	1'908'075.00	0.19	a)
CH0260769424	1.3750 % T 1 3/8 12/04/24	4'650	0	4'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260769440	1.8750 % T 1 7/8 12/04/30	1'535	300	500	1'335 CHF	102.00%	1'361'700.00	0.14	a)
CH0266842704	1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN	1'365	0	1'365	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	3'600	150	690	3'060 CHF	97.25%	2'975'850.00	0.30	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	8'750	0	8'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	4'530	500	1'800	3'230 CHF	96.95%	3'131'485.00	0.32	a)
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	2'220	0	375	1'845 CHF	99.05%	1'827'472.50	0.19	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	1'300	150	350	1'100 CHF	98.56%	1'084'160.00	0.11	a)
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	2'000	0	300	1'700 CHF	97.40%	1'655'800.00	0.17	a)
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	150	1'000	250	900 CHF	99.77%	897'930.00	0.09	a)
CH0284415681	0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN	3'300	0	800	2'500 CHF	98.70%	2'467'500.00	0.25	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	2'010	0	250	1'760 CHF	98.10%	1'726'560.00	0.17	a)
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	5'440	0	850	4'590 CHF	97.65%	4'482'135.00	0.45	a)
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	1'200	0	200	1'000 CHF	100.55%	1'005'500.00	0.10	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	5'300	0	300	5'000 CHF	98.70%	4'935'000.00	0.50	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	2'650	0	400	2'250 CHF	97.85%	2'201'625.00	0.22	a)
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	1'700	0	200	1'500 CHF	97.80%	1'467'000.00	0.15	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	2'000	400	500	1'900 CHF	97.20%	1'846'800.00	0.19	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	3'575	300	400	3'475 CHF	97.45%	3'386'387.50	0.34	a)
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	1'900	0	0	1'900 CHF	98.60%	1'873'400.00	0.19	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	1'500	550	300	1'750 CHF	97.45%	1'705'375.00	0.17	a)
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	4'100	0	4'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315593860	0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.50%	965'000.00	0.10	a)
CH0319415953	0.5500 % UBS 0.55 04/15/24 EMTN	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'000	500	0	1'500 CHF	97.15%	1'457'250.00	0.15	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	6'540	0	6'540	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	2'930	1'300	800	3'430 CHF	96.55%	3'311'665.00	0.34	a)
CH0323735677	0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN	1'250	0	250	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.10	a)
CH0325429188	0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN	3'195	0	3'195	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	1'125	0	0	1'125 CHF	94.70%	1'065'375.00	0.11	a)
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	1'050	0	150	900 CHF	96.55%	868'950.00	0.09	a)
CH0337829268	0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN	1'650	0	250	1'400 CHF	91.60%	1'282'400.00	0.13	a)
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	3'755	0	3'755	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	2'025	0	600	1'425 CHF	97.30%	1'386'525.00	0.14	a)
CH0341725858	0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN	4'130	0	4'130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	1'150	550	400	1'300 CHF	95.85%	1'246'050.00	0.13	a)
CH0343366800	0.2000 % NBRNS 0.2 11/07/31	4'215	150	900	3'465 CHF	90.90%	3'149'685.00	0.32	a)
CH0346190033	0.2500 % BNCHIL 0 1/4 12/05/24	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	3'245	0	550	2'695 CHF	97.90%	2'638'405.00	0.27	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	2'950	300	650	2'600 CHF	94.65%	2'460'900.00	0.25	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	2'250	400	495	2'155 CHF	97.55%	2'102'202.50	0.21	a)
CH0350030414	0.2000 % ASBBNK 0.2 08/02/24 EMTN	2'040	0	2'040	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	2'300	200	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0355139855	0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357520433	0.2500 % ANZLN 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'950	0	200	1'750 CHF	98.05%	1'715'875.00	0.17	a)
CH0357520466	0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN	2'150	0	600	1'550 CHF	97.40%	1'509'700.00	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172701	0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN	600	0	0	600 CHF	95.00%	570'000.00	0.06	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	3'500	0	1'300	2'200 CHF	98.30%	2'162'600.00	0.22	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	2'400	0	900	1'500 CHF	91.15%	1'367'250.00	0.14	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	1'500	600	550	1'550 CHF	90.45%	1'401'975.00	0.14	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	1'400	0	300	1'100 CHF	95.65%	1'052'150.00	0.11	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	3'050	0	3'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0365501508	0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN	1'750	0	1'750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0367206676	1.0000 % VZ 1 11/30/27 EMTN	4'200	0	750	3'450 CHF	97.75%	3'372'375.00	0.34	a)
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	4'150	0	500	3'650 CHF	94.45%	3'447'425.00	0.35	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	2'500	150	400	2'250 CHF	97.80%	2'200'500.00	0.22	a)
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	2'450	500	700	2'250 CHF	98.07%	2'206'575.00	0.22	a)
CH0370634666	0.6250 % ACAFP 0 5/8 07/12/24 EMTN	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0372831534	1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27	2'000	0	400	1'600 CHF	98.40%	1'574'400.00	0.16	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	2'100	300	255	2'145 CHF	96.15%	2'062'417.50	0.21	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	2'900	0	550	2'350 CHF	97.90%	2'300'650.00	0.23	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	2'650	0	500	2'150 CHF	94.05%	2'022'075.00	0.20	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	1'900	0	100	1'800 CHF	96.65%	1'739'700.00	0.18	a)
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	1'100	0	300	800 CHF	98.15%	785'200.00	0.08	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	5'700	150	1'000	4'850 CHF	96.30%	4'670'550.00	0.47	a)
CH0383104343	0.5500 % NESNVX 0.55 10/04/32 EMTN	1'550	0	300	1'250 CHF	93.10%	1'163'750.00	0.12	a)
CH0384125040	0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	4'600	200	800	4'000 CHF	97.20%	3'888'000.00	0.39	a)
CH0385997108	0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN	3'150	250	650	2'750 CHF	94.25%	2'591'875.00	0.26	a)
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	1'700	0	300	1'400 CHF	91.70%	1'283'800.00	0.13	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	2'800	600	1'200	2'200 CHF	96.35%	2'119'700.00	0.21	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	2'600	0	200	2'400 CHF	97.85%	2'348'400.00	0.24	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	1'850	0	300	1'550 CHF	83.70%	1'297'350.00	0.13	a)
CH0398677689	0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN	2'800	0	2'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	1'810	0	1'810	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398677747	0.3500 % ANZLN 0.35 10/22/24 EMTN	2'300	0	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	2'250	0	500	1'750 CHF	95.85%	1'677'375.00	0.17	a)
CH0401956864	0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956872	0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN	750	0	0	750 CHF	95.05%	712'875.00	0.07	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	1'750	250	250	1'750 CHF	97.85%	1'712'375.00	0.17	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	1'400	0	1'400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0404599224	0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	2'100	0	400	1'700 CHF	97.30%	1'654'100.00	0.17	a)
CH0407809778	0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	2'000	0	200	1'800 CHF	98.75%	1'777'500.00	0.18	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	3'015	0	1'400	1'615 CHF	98.22%	1'586'253.00	0.16	a)
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	1'600	200	0	1'800 CHF	98.50%	1'773'000.00	0.18	a)
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	3'500	0	650	2'850 CHF	99.20%	2'827'200.00	0.29	a)
CH0417086060	0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN	2'150	0	2'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	4'000	200	850	3'350 CHF	96.10%	3'219'350.00	0.33	a)
CH0418620180	1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN	1'250	0	250	1'000 CHF	98.96%	989'600.00	0.10	a)
CH0419040826	0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041311	0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	1'200	0	300	900 CHF	92.25%	830'250.00	0.08	a)
CH0419041543	0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN	2'600	0	2'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041568	0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN	3'300	0	3'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041642	0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN	1'400	200	200	1'400 CHF	94.80%	1'327'200.00	0.13	a)
CH0419041667	0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN	1'600	150	400	1'350 CHF	93.80%	1'266'300.00	0.13	a)
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	3'200	0	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	1'470	350	1'200	620 CHF	97.30%	603'260.00	0.06	a)
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	4'130	150	800	3'480 CHF	96.50%	3'358'200.00	0.34	a)
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	1'100	0	200	900 CHF	98.71%	888'390.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	2'100	350	700	1'750 CHF	97.55%	1'707'125.00	0.17	a)
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	1'500	0	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	3'600	350	1'800	2'150 CHF	99.25%	2'133'875.00	0.22	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'400	0	100	1'300 CHF	95.85%	1'246'050.00	0.13	a)
CH0435590390	1.2500 % GLENLN 1 1/4 10/09/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	98.05%	784'400.00	0.08	a)
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	97.70%	781'600.00	0.08	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	8'550	500	1'200	7'850 CHF	97.70%	7'669'450.00	0.78	a)
CH0441186522	0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	2'150	0	500	1'650 CHF	98.90%	1'631'850.00	0.17	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	1'200	0	100	1'100 CHF	95.35%	1'048'850.00	0.11	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	4'200	0	1'100	3'100 CHF	95.50%	2'960'500.00	0.30	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	4'150	0	700	3'450 CHF	96.45%	3'327'525.00	0.34	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	1'210	0	350	860 CHF	94.60%	813'560.00	0.08	a)
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	2'550	0	300	2'250 CHF	94.65%	2'129'625.00	0.22	a)
CH0460054460	0.8000 % MP 0.8 03/15/39 EMTN	1'900	0	550	1'350 CHF	90.20%	1'217'700.00	0.12	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	1'300	0	350	950 CHF	93.95%	892'525.00	0.09	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238948	1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN	1'050	900	1'050	900 CHF	90.95%	818'550.00	0.08	a)
CH0461238997	0.0200 % TPNZ 0.02 12/16/27	1'440	0	340	1'100 CHF	94.95%	1'044'450.00	0.11	a)
CH0461239003	0.1250 % NBRNS 0 1/8 12/06/32	1'200	0	250	950 CHF	88.30%	838'850.00	0.08	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	1'550	0	350	1'200 CHF	82.00%	984'000.00	0.10	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	3'150	0	570	2'580 CHF	93.25%	2'405'850.00	0.24	a)
CH0463112042	0.5780 % FNPLAT 0.578 03/11/24	1'650	0	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	1'200	0	500	700 CHF	90.65%	634'550.00	0.06	a)
CH0463112067	0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044607	0.2000 % CABEI 0.2 03/25/24 EMTN	1'850	0	1'850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044623	0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN	3'000	0	3'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	2'750	0	510	2'240 CHF	97.90%	2'192'960.00	0.22	a)
CH0465044680	0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465767769	1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN	1'400	0	200	1'200 CHF	98.60%	1'183'200.00	0.12	a)
CH0465767785	0.3840 % BSANCI 0.384 09/27/24 EMTN	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	3'100	250	700	2'650 CHF	98.15%	2'600'975.00	0.26	a)
CH0467182413	0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN	2'200	0	350	1'850 CHF	96.70%	1'788'950.00	0.18	a)
CH0467182421	0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN	2'100	0	245	1'855 CHF	98.14%	1'820'497.00	0.18	a)
CH0467182439	0.0219 % INDKOR 0.0219 07/16/25 EMTN	2'700	700	1'400	2'000 CHF	97.65%	1'953'000.00	0.20	a)
CH0467182454	1.0183 % MBKPW 1.0183 10/04/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	6'900	0	1'200	5'700 CHF	95.35%	5'434'950.00	0.55	a)
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	2'000	0	200	1'800 CHF	92.35%	1'662'300.00	0.17	a)
CH0471298007	0.4000 % BCICI 0.4 11/22/24 EMTN	1'700	0	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'800	0	1'000	800 CHF	93.05%	744'400.00	0.08	a)
CH0472691440	0.5000 % ADCBUH 0 1/2 11/29/24 EMTN	1'150	0	1'150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977672	0.1000 % HYN0E 0.1 11/27/24 EMTN	1'200	0	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'600	0	350	1'250 CHF	97.10%	1'213'750.00	0.12	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	3'950	250	1'050	3'150 CHF	97.05%	3'057'075.00	0.31	a)
CH0474977755	0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN	1'850	0	550	1'300 CHF	97.40%	1'266'200.00	0.13	a)
CH0474977938	0.0000 % KORAIL 0 06/13/25	1'000	500	150	1'350 CHF	97.81%	1'320'435.00	0.13	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	1'600	0	150	1'450 CHF	97.90%	1'419'550.00	0.14	a)
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	950	0	0	950 CHF	96.65%	918'175.00	0.09	a)
CH0479514272	0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMNT	2'940	600	450	3'090 CHF	93.90%	2'901'510.00	0.29	a)
CH0479514280	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN	1'450	0	0	1'450 CHF	91.20%	1'322'400.00	0.13	a)
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	2'200	400	800	1'800 CHF	94.55%	1'701'900.00	0.17	a)
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	2'500	0	200	2'300 CHF	91.10%	2'095'300.00	0.21	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	2'150	0	350	1'800 CHF	92.85%	1'671'300.00	0.17	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	2'600	0	600	2'000 CHF	95.05%	1'901'000.00	0.19	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0482172357	0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN	2'300	0	550	1'750 CHF	95.30%	1'667'750.00	0.17	a)
CH0482172415	0.5700 % GYCGR 0.57 06/24/24 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180920	1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	98.23%	1'276'990.00	0.13	a)
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	4'200	0	750	3'450 CHF	97.80%	3'374'100.00	0.34	a)
CH0483180961	0.6250 % ORAFP 0 5/8 06/22/29 EMTN	1'300	0	450	850 CHF	95.45%	811'325.00	0.08	a)
CH0485445958	0.0000 % KOHNPW 0 07/19/24 EMTN	2'200	0	2'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445966	0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN	900	0	0	900 CHF	94.30%	848'700.00	0.09	a)
CH0485445982	0.0000 % NWISE 0 07/11/25 EMTN	2'550	0	350	2'200 CHF	97.83%	2'152'260.00	0.22	a)
CH0485445990	0.1675 % NWISE 0.1675 07/11/31 EMTN	2'045	0	700	1'345 CHF	90.35%	1'215'207.50	0.12	a)
CH0487087337	0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN	2'710	0	700	2'010 CHF	89.35%	1'795'935.00	0.18	a)
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'300	0	0	2'300 CHF	97.80%	2'249'400.00	0.23	a)
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	1'000	0	100	900 CHF	89.00%	801'000.00	0.08	a)
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	1'000	0	100	900 CHF	89.00%	801'000.00	0.08	a)
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	3'750	0	500	3'250 CHF	95.95%	3'118'375.00	0.32	a)
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	95.90%	1'150'800.00	0.12	a)
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	1'800	0	500	1'300 CHF	92.00%	1'196'000.00	0.12	a)
CH0502393389	0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN	1'050	250	500	800 CHF	95.25%	762'000.00	0.08	a)
CH0503144393	0.2500 % BFCM 0 1/4 10/24/29 EMTN	1'000	0	150	850 CHF	91.50%	777'750.00	0.08	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	3'450	0	590	2'860 CHF	94.60%	2'705'560.00	0.27	a)
CH0505011889	0.2500 % BCICI 0 1/4 10/29/25 EMTN	1'100	0	150	950 CHF	97.15%	922'925.00	0.09	a)
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'100	0	100	2'000 CHF	94.40%	1'888'000.00	0.19	a)
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	700	0	0	700 CHF	96.70%	676'900.00	0.07	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	2'000	200	600	1'600 CHF	93.20%	1'491'200.00	0.15	a)
CH0506071239	0.1000 % BCICI 0.1 09/18/26 EMTN	900	400	300	1'000 CHF	94.70%	947'000.00	0.10	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	1'200	200	400	1'000 CHF	96.90%	969'000.00	0.10	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	1'000	0	150	850 CHF	94.00%	799'000.00	0.08	a)
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	1'700	0	500	1'200 CHF	98.04%	1'176'480.00	0.12	a)
CH0508785737	0.1500 % SANSCEF 0.15 12/10/24 EMTN	2'100	0	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	2'000	700	1'300	1'400 CHF	91.85%	1'285'900.00	0.13	a)
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	3'150	0	550	2'600 CHF	90.65%	2'356'900.00	0.24	a)
CH0517825284	0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN	1'550	200	600	1'150 CHF	93.30%	1'072'950.00	0.11	a)
CH0517825292	0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN	2'000	0	500	1'500 CHF	92.90%	1'393'500.00	0.14	a)
CH0517825318	0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN	3'215	0	3'215	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	2'300	0	760	1'540 CHF	92.90%	1'430'660.00	0.14	a)
CH0517825334	0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN	2'400	0	200	2'200 CHF	97.05%	2'135'100.00	0.22	a)
CH0519933219	0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663664	0.5000 % BANORT 0 1/2 12/06/24	2'350	0	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	2'300	800	400	2'700 CHF	91.50%	2'470'500.00	0.25	a)
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	1'600	0	200	1'400 CHF	95.25%	1'333'500.00	0.14	a)
CH0522158812	0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN	2'000	0	200	1'800 CHF	92.25%	1'660'500.00	0.17	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	1'350	600	500	1'450 CHF	93.10%	1'349'950.00	0.14	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	3'500	0	650	2'850 CHF	89.60%	2'553'600.00	0.26	a)
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	1'600	0	0	1'600 CHF	95.75%	1'532'000.00	0.16	a)
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	1'300	0	400	900 CHF	100.40%	903'600.00	0.09	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	1'800	0	400	1'400 CHF	95.90%	1'342'600.00	0.14	a)
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	1'600	0	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	1'300	0	200	1'100 CHF	88.20%	970'200.00	0.10	a)
CH0528881227	0.2500 % ALTA 0 1/4 04/20/28 EMTN	1'150	850	0	2'000 CHF	95.75%	1'915'000.00	0.19	a)
CH0537261866	0.7000 % MP 0.7 04/20/40 EMTN	1'000	0	150	850 CHF	86.60%	736'100.00	0.07	a)
CH0538763514	0.8750 % KORAIL 0 7/8 04/21/25	1'000	1'150	330	1'820 CHF	98.98%	1'801'436.00	0.18	a)
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	2'500	700	700	2'500 CHF	98.53%	2'463'250.00	0.25	a)
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	1'100	0	300	800 CHF	98.76%	790'080.00	0.08	a)
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	1'150	200	500	850 CHF	97.00%	824'500.00	0.08	a)
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	2'000	0	300	1'700 CHF	96.65%	1'643'050.00	0.17	a)
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	1'400	270	0	1'670 CHF	94.35%	1'575'645.00	0.16	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	1'550	0	200	1'350 CHF	91.50%	1'235'250.00	0.13	a)
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	1'300	700	150	1'850 CHF	98.16%	1'815'960.00	0.18	a)
CH0550103078	0.4050 % CABEI 0.405 06/25/25 EMTN	1'540	200	200	1'540 CHF	98.08%	1'510'432.00	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	2'720	0	100	2'620 CHF	92.95%	2'435'290.00	0.25	a)
CH0550413394	0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	96.70%	1'547'200.00	0.16	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	3'500	200	400	3'300 CHF	98.20%	3'240'600.00	0.33	a)
CH0554992070	0.2625 % KOROLIL 0.2625 07/30/27 EMTN	2'150	0	350	1'800 CHF	95.55%	1'719'900.00	0.17	a)
CH0555837753	1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN	1'200	0	275	925 CHF	98.70%	912'975.00	0.09	a)
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	3'300	0	685	2'615 CHF	93.20%	2'437'180.00	0.25	a)
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	92.95%	1'487'200.00	0.15	a)
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	3'750	0	600	3'150 CHF	92.00%	2'898'000.00	0.29	a)
CH0568231861	1.0000 % GLENLN 1 03/30/27 EMTN	2'500	0	555	1'945 CHF	97.35%	1'893'457.50	0.19	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	2'600	0	400	2'200 CHF	93.40%	2'054'800.00	0.21	a)
CH0569237701	1.2050 % AFRFIN 1.205 09/30/25 EMTN	1'600	0	310	1'290 CHF	97.20%	1'253'880.00	0.13	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	2'700	0	300	2'400 CHF	97.95%	2'350'800.00	0.24	a)
CH0575017105	0.7350 % COMQAT 0.735 11/27/24 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	2'300	0	580	1'720 CHF	95.10%	1'635'720.00	0.17	a)
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	4'400	0	800	3'600 CHF	85.40%	3'074'400.00	0.31	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	1'200	0	400	800 CHF	94.30%	754'400.00	0.08	a)
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	1'600	0	400	1'200 CHF	93.10%	1'117'200.00	0.11	a)
CH0593893917	0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN	1'700	200	100	1'800 CHF	91.35%	1'644'300.00	0.17	a)
CH0593893925	0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN	2'900	0	600	2'300 CHF	94.55%	2'174'650.00	0.22	a)
CH0593893933	0.5560 % FNPLAT 0.556 09/03/26	1'950	250	580	1'620 CHF	94.90%	1'537'380.00	0.16	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'800	0	250	1'550 CHF	77.35%	1'198'925.00	0.12	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	1'400	0	150	1'250 CHF	79.75%	996'875.00	0.10	a)
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	1'400	0	600	800 CHF	94.65%	757'200.00	0.08	a)
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	1'700	0	400	1'300 CHF	89.30%	1'160'900.00	0.12	a)
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'300	0	200	1'100 CHF	90.35%	993'850.00	0.10	a)
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	1'200	0	0	1'200 CHF	88.90%	1'066'800.00	0.11	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	2'250	0	200	2'050 CHF	91.65%	1'878'825.00	0.19	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	2'550	350	1'000	1'900 CHF	81.30%	1'544'700.00	0.16	a)
CH1100259824	0.1950 % COMQAT 0.195 04/22/24 EMTN	1'800	0	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1104885954	0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	97.95%	1'861'050.00	0.19	a)
CH1105672658	0.1925 % VZ 0.1925 03/24/28	3'900	150	750	3'300 CHF	94.50%	3'118'500.00	0.32	a)
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	3'550	0	700	2'850 CHF	92.50%	2'636'250.00	0.27	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	4'700	0	580	4'120 CHF	90.70%	3'736'840.00	0.38	a)
CH1108704839	0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN	2'000	0	350	1'650 CHF	92.50%	1'526'250.00	0.15	a)
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	3'000	0	1'000	2'000 CHF	88.25%	1'765'000.00	0.18	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	4'800	400	1'300	3'900 CHF	94.40%	3'681'600.00	0.37	a)
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	4'850	0	750	4'100 CHF	94.25%	3'864'250.00	0.39	a)
CH1112011593	0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN	2'200	200	600	1'800 CHF	95.35%	1'716'300.00	0.17	a)
CH1112011601	0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN	1'500	0	200	1'300 CHF	94.10%	1'223'300.00	0.12	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	2'000	600	400	2'200 CHF	95.35%	2'097'700.00	0.21	a)
CH1115424702	0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN	1'700	0	320	1'380 CHF	92.00%	1'269'600.00	0.13	a)
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	3'000	0	700	2'300 CHF	90.60%	2'083'800.00	0.21	a)
CH1118460984	0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN	1'400	0	0	1'400 CHF	92.00%	1'288'000.00	0.13	a)
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	1'600	350	600	1'350 CHF	93.05%	1'256'175.00	0.13	a)
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	3'350	0	550	2'800 CHF	94.10%	2'634'800.00	0.27	a)
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	2'750	0	400	2'350 CHF	93.65%	2'200'775.00	0.22	a)
CH1120085696	0.3850 % BCICI 0.385 12/15/26 EMTN	800	250	150	900 CHF	94.85%	853'650.00	0.09	a)
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	2'600	200	1'000	1'800 CHF	89.35%	1'608'300.00	0.16	a)
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	3'000	0	800	2'200 CHF	95.10%	2'092'200.00	0.21	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	3'000	0	650	2'350 CHF	91.40%	2'147'900.00	0.22	a)
CH1121837251	0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN	2'900	0	600	2'300 CHF	89.15%	2'050'450.00	0.21	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	900	500	400	1'000 CHF	83.10%	831'000.00	0.08	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	2'400	0	400	2'000 CHF	94.50%	1'890'000.00	0.19	a)
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	2'400	0	250	2'150 CHF	91.85%	1'974'775.00	0.20	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	90.35%	993'850.00	0.10	a)
CH1132966263	0.5000 % GLENLN 0 1/2 09/07/28 EMTN	1'600	0	350	1'250 CHF	94.35%	1'179'375.00	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1132966271	0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN	800	400	200	1'000 CHF	92.20%	922'000.00	0.09	a)
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	2'100	0	400	1'700 CHF	88.15%	1'498'550.00	0.15	a)
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	2'400	0	400	2'000 CHF	94.45%	1'889'000.00	0.19	a)
CH1135555576	0.1700 % CABEI 0.17 09/29/31 EMTN	2'000	0	300	1'700 CHF	86.45%	1'469'650.00	0.15	a)
CH1135555584	0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN	1'700	0	0	1'700 CHF	91.90%	1'562'300.00	0.16	a)
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	2'300	0	500	1'800 CHF	91.35%	1'644'300.00	0.17	a)
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'700	0	300	1'400 CHF	91.70%	1'283'800.00	0.13	a)
CH1137122789	1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	3'100	0	600	2'500 CHF	91.85%	2'296'250.00	0.23	a)
CH1137122813	0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN	1'700	0	300	1'400 CHF	93.75%	1'312'500.00	0.13	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	3'100	0	530	2'570 CHF	92.85%	2'386'245.00	0.24	a)
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	1'300	0	300	1'000 CHF	94.50%	945'000.00	0.10	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	2'900	0	450	2'450 CHF	92.25%	2'260'125.00	0.23	a)
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	2'000	0	450	1'550 CHF	92.75%	1'437'625.00	0.15	a)
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	1'000	0	150	850 CHF	92.50%	786'250.00	0.08	a)
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	800	0	0	800 CHF	94.80%	758'400.00	0.08	a)
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	3'600	200	700	3'100 CHF	96.20%	2'982'200.00	0.30	a)
CH1142512321	0.3154 % BNCHIL 0.3154 01/04/27 EMTN	1'800	250	900	1'150 CHF	94.75%	1'089'625.00	0.11	a)
CH1142512339	0.5994 % BCICI 0.5994 04/26/27 EMTN	2'200	0	450	1'750 CHF	95.80%	1'676'500.00	0.17	a)
CH1142512347	0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN	2'200	0	200	2'000 CHF	94.55%	1'891'000.00	0.19	a)
CH1142512362	2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN	2'400	200	1'000	1'600 CHF	103.85%	1'661'600.00	0.17	a)
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	2'200	200	500	1'900 CHF	95.25%	1'809'750.00	0.18	a)
CH1142754287	0.7950 % FNPLAT 0.795 12/01/28	1'700	0	350	1'350 CHF	91.80%	1'239'300.00	0.13	a)
CH1142754303	0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN	1'800	0	320	1'480 CHF	93.85%	1'388'980.00	0.14	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	3'950	0	660	3'290 CHF	92.95%	3'058'055.00	0.31	a)
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	3'000	400	800	2'600 CHF	95.00%	2'470'000.00	0.25	a)
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	3'200	0	800	2'400 CHF	89.90%	2'157'600.00	0.22	a)
CH1145096181	0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN	1'900	0	200	1'700 CHF	95.95%	1'631'150.00	0.17	a)
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	2'850	0	650	2'200 CHF	93.75%	2'062'500.00	0.21	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'400	250	100	1'550 CHF	93.05%	1'442'275.00	0.15	a)
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	1'800	650	700	1'750 CHF	93.80%	1'641'500.00	0.17	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	2'200	0	450	1'750 CHF	89.45%	1'565'375.00	0.16	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	2'400	0	500	1'900 CHF	92.10%	1'749'900.00	0.18	a)
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	2'300	0	500	1'800 CHF	92.15%	1'658'700.00	0.17	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	3'400	0	700	2'700 CHF	95.90%	2'589'300.00	0.26	a)
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	4'100	0	1'100	3'000 CHF	95.95%	2'878'500.00	0.29	a)
CH1154887116	0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN	1'400	0	350	1'050 CHF	92.05%	966'525.00	0.10	a)
CH1154887157	0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN	2'200	0	600	1'600 CHF	93.20%	1'491'200.00	0.15	a)
CH1159841332	0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN	1'500	0	100	1'400 CHF	95.90%	1'342'600.00	0.14	a)
CH1159841340	0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN	1'600	0	800	800 CHF	93.30%	746'400.00	0.08	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	1'800	300	400	1'700 CHF	95.10%	1'616'700.00	0.16	a)
CH1160188327	0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	93.55%	748'400.00	0.08	a)
CH1160382904	0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25	1'380	0	1'380	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	2'100	150	450	1'800 CHF	97.25%	1'750'500.00	0.18	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	1'800	0	600	1'200 CHF	96.95%	1'163'400.00	0.12	a)
CH1163572915	0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1163572931	0.5250 % SCDA 0.525 03/01/32	1'100	200	500	800 CHF	93.55%	748'400.00	0.08	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	950	0	0	950 CHF	96.90%	920'550.00	0.09	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	1'750	0	500	1'250 CHF	96.80%	1'210'000.00	0.12	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	3'300	200	1'195	2'305 CHF	96.50%	2'224'325.00	0.23	a)
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	2'400	0	600	1'800 CHF	99.11%	1'783'980.00	0.18	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	1'300	0	200	1'100 CHF	96.80%	1'064'800.00	0.11	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	2'550	0	0	2'550 CHF	97.35%	2'482'425.00	0.25	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	2'200	150	500	1'850 CHF	97.00%	1'794'500.00	0.18	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	900	350	0	1'250 CHF	96.90%	1'211'250.00	0.12	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	700	700	500	900 CHF	97.70%	879'300.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1175016125	1.7000 % DLR 1.7 03/30/27	1'600	0	300	1'300 CHF	98.55%	1'281'150.00	0.13	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	1'100	400	950	550 CHF	98.47%	541'585.00	0.05	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	1'100	0	250	850 CHF	96.00%	816'000.00	0.08	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	2'600	0	350	2'250 CHF	96.95%	2'181'375.00	0.22	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	1'900	300	225	1'975 CHF	98.15%	1'938'462.50	0.20	a)
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	2'200	0	450	1'750 CHF	97.25%	1'701'875.00	0.17	a)
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	1'900	0	500	1'400 CHF	99.30%	1'390'200.00	0.14	a)
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	2'300	0	600	1'700 CHF	99.00%	1'683'000.00	0.17	a)
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	2'100	0	300	1'800 CHF	99.40%	1'789'200.00	0.18	a)
CH1181713616	1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN	2'100	0	350	1'750 CHF	98.40%	1'722'000.00	0.17	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	1'800	0	400	1'400 CHF	97.40%	1'363'600.00	0.14	a)
CH1184694714	1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN	3'600	0	600	3'000 CHF	98.95%	2'968'500.00	0.30	a)
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	1'800	0	350	1'450 CHF	100.10%	1'451'450.00	0.15	a)
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	2'350	300	750	1'900 CHF	98.40%	1'869'600.00	0.19	a)
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	1'300	0	250	1'050 CHF	97.40%	1'022'700.00	0.10	a)
CH1184694763	1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN	2'350	0	600	1'750 CHF	99.62%	1'743'350.00	0.18	a)
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	1'700	0	150	1'550 CHF	99.35%	1'539'925.00	0.16	a)
CH1187450817	1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN	1'900	0	400	1'500 CHF	99.30%	1'489'500.00	0.15	a)
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	1'800	0	300	1'500 CHF	99.05%	1'485'750.00	0.15	a)
CH1187520478	1.1580 % HYUCAP 1.158 06/14/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	1'050	0	200	850 CHF	100.15%	851'275.00	0.09	a)
CH1187520494	1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN	2'000	0	600	1'400 CHF	99.55%	1'393'700.00	0.14	a)
CH1191066245	0.8000 % ASIA 0.8 07/06/27 EMTN	1'800	500	600	1'700 CHF	98.80%	1'679'600.00	0.17	a)
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	1'850	0	800	1'050 CHF	99.30%	1'042'650.00	0.11	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	2'200	0	400	1'800 CHF	100.05%	1'800'900.00	0.18	a)
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	2'700	0	0	2'700 CHF	99.88%	2'696'760.00	0.27	a)
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	1'800	600	150	2'250 CHF	99.20%	2'232'000.00	0.23	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	2'100	200	500	1'800 CHF	100.65%	1'811'700.00	0.18	a)
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	1'100	1'000	600	1'500 CHF	98.85%	1'482'750.00	0.15	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	1'900	0	450	1'450 CHF	101.40%	1'470'300.00	0.15	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	1'800	0	350	1'450 CHF	99.95%	1'449'275.00	0.15	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	1'900	250	400	1'750 CHF	98.75%	1'728'125.00	0.18	a)
CH1202242264	3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN	2'200	0	400	1'800 CHF	102.70%	1'848'600.00	0.19	a)
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	3'800	0	400	3'400 CHF	100.10%	3'403'400.00	0.34	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	2'450	150	400	2'200 CHF	99.10%	2'180'200.00	0.22	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'530	0	300	2'230 CHF	98.75%	2'202'125.00	0.22	a)
CH1204259753	0.8750 % ASIA 0 7/8 09/13/29 EMTN	1'600	0	720	880 CHF	98.30%	865'040.00	0.09	a)
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	2'300	0	600	1'700 CHF	98.85%	1'680'450.00	0.17	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	3'300	0	750	2'550 CHF	104.50%	2'664'750.00	0.27	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	2'875	550	850	2'575 CHF	101.45%	2'612'337.50	0.26	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	2'400	0	450	1'950 CHF	100.50%	1'959'750.00	0.20	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	900	250	350	800 CHF	100.55%	804'400.00	0.08	a)
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	1'300	0	500	800 CHF	101.35%	810'800.00	0.08	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	2'000	0	700	1'300 CHF	100.20%	1'302'600.00	0.13	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	1'800	0	400	1'400 CHF	101.40%	1'419'600.00	0.14	a)
CH1213243913	3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN	1'400	0	200	1'200 CHF	103.80%	1'245'600.00	0.13	a)
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	101.85%	1'324'050.00	0.13	a)
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	1'400	0	300	1'100 CHF	102.90%	1'131'900.00	0.11	a)
CH1216400049	2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25	1'600	0	600	1'000 CHF	101.30%	1'013'000.00	0.10	a)
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	1'300	500	400	1'400 CHF	100.75%	1'410'500.00	0.14	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	1'400	0	200	1'200 CHF	102.75%	1'233'000.00	0.12	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCKN 1.66 10/18/27 EMTN	700	850	700	850 CHF	100.85%	857'225.00	0.09	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	800	0	0	800 CHF	102.10%	816'800.00	0.08	a)
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	800	400	250	950 CHF	104.00%	988'000.00	0.10	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	2'800	300	650	2'450 CHF	101.80%	2'494'100.00	0.25	a)
CH1227937690	1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN	1'800	0	200	1'600 CHF	100.30%	1'604'800.00	0.16	a)
CH1227937708	2.5025 % EOANGR 2.5025 12/05/29 EMTN	1'600	300	1'000	900 CHF	104.80%	943'200.00	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1227937716	2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN	3'400	0	400	3'000 CHF	102.55%	3'076'500.00	0.31	a)
CH1227937724	2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN	2'300	250	1'000	1'550 CHF	101.05%	1'566'275.00	0.16	a)
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	0	2'600	600	2'000 CHF	102.35%	2'047'000.00	0.21	a)
CH1228837865	2.3300 % UBS 2.33 11/14/25	4'000	0	500	3'500 CHF	101.15%	3'540'250.00	0.36	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	2'600	0	350	2'250 CHF	99.85%	2'246'625.00	0.23	a)
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	2'100	800	1'300	1'600 CHF	101.25%	1'620'000.00	0.16	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	2'100	0	300	1'800 CHF	104.45%	1'880'100.00	0.19	a)
CH1228838129	2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN	1'400	250	0	1'650 CHF	113.15%	1'866'975.00	0.19	a)
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	1'900	200	0	2'100 CHF	100.00%	2'100'000.00	0.21	a)
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	2'000	0	300	1'700 CHF	102.60%	1'744'200.00	0.18	a)
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	0	1'700	650	1'050 CHF	101.90%	1'069'950.00	0.11	a)
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	1'200	0	400	800 CHF	102.15%	817'200.00	0.08	a)
CH1231312682	2.1375 % CABEI 2.1375 12/13/27 EMTN	1'200	300	550	950 CHF	100.75%	957'125.00	0.10	a)
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	800	0	0	800 CHF	101.50%	812'000.00	0.08	a)
CH1231312708	2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN	2'400	0	600	1'800 CHF	103.10%	1'855'800.00	0.19	a)
CH1231312716	2.1500 % KOROIL 2.15 12/19/24	1'100	0	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	1'600	0	300	1'300 CHF	102.25%	1'329'250.00	0.13	a)
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	1'300	0	200	1'100 CHF	101.05%	1'111'550.00	0.11	a)
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	3'400	0	450	2'950 CHF	100.25%	2'957'375.00	0.30	a)
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	1'900	400	1'000	1'300 CHF	102.70%	1'335'100.00	0.14	a)
CH1236363425	2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN	1'600	0	200	1'400 CHF	102.10%	1'429'400.00	0.14	a)
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	1'400	150	550	1'000 CHF	101.85%	1'018'500.00	0.10	a)
CH1239495042	3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28	720	250	100	870 CHF	104.20%	906'540.00	0.09	a)
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	2'700	0	500	2'200 CHF	99.85%	2'196'700.00	0.22	a)
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	3'400	200	800	2'800 CHF	100.85%	2'823'800.00	0.29	a)
CH1242969199	2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN	2'500	200	550	2'150 CHF	101.60%	2'184'400.00	0.22	a)
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	1'700	150	400	1'450 CHF	99.50%	1'442'750.00	0.15	a)
CH1243018806	2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN	2'600	0	1'200	1'400 CHF	101.25%	1'417'500.00	0.14	a)
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	2'500	150	500	2'150 CHF	102.45%	2'202'675.00	0.22	a)
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	2'700	0	400	2'300 CHF	101.35%	2'331'050.00	0.24	a)
CH1243651986	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 MAR	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933558	2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN	2'200	150	550	1'800 CHF	101.60%	1'828'800.00	0.19	a)
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	2'000	0	700	1'300 CHF	100.25%	1'303'250.00	0.13	a)
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	1'100	0	250	850 CHF	100.80%	856'800.00	0.09	a)
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	2'100	250	700	1'650 CHF	101.95%	1'682'175.00	0.17	a)
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	2'600	0	400	2'200 CHF	102.95%	2'264'900.00	0.23	a)
CH1244321761	2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN	0	2'400	400	2'000 CHF	104.25%	2'085'000.00	0.21	a)
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	1'800	400	1'400 CHF	101.65%	1'423'100.00	0.14	a)
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	1'800	400	1'400 CHF	101.35%	1'418'900.00	0.14	a)
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	2'500	350	2'150 CHF	103.40%	2'223'100.00	0.23	a)
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	1'800	500	1'300 CHF	101.40%	1'318'200.00	0.13	a)
CH1244731753	2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTN	1'400	0	400	1'000 CHF	102.10%	1'021'000.00	0.10	a)
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	1'700	250	1'300	650 CHF	100.80%	655'200.00	0.07	a)
CH1245295758	3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN	2'400	0	900	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.15	a)
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	1'900	200	550	1'550 CHF	101.10%	1'567'050.00	0.16	a)
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	2'600	0	350	2'250 CHF	103.40%	2'326'500.00	0.24	a)
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'500	0	300	1'200 CHF	102.30%	1'227'600.00	0.12	a)
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	1'000	0	200	800 CHF	102.15%	817'200.00	0.08	a)
CH1249416004	2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN	1'100	0	500	600 CHF	104.40%	626'400.00	0.06	a)
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	1'000	200	200	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.10	a)
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	2'800	0	150	2'650 CHF	103.85%	2'752'025.00	0.28	a)
CH1251030099	2.6250 % ABNAV 2 5/8 03/02/28 EMTN	3'200	200	400	3'000 CHF	101.90%	3'057'000.00	0.31	a)
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	4'000	150	1'030	3'120 CHF	101.65%	3'171'480.00	0.32	a)
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	2'400	0	450	1'950 CHF	103.30%	2'014'350.00	0.20	a)
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	3'200	750	2'450 CHF	102.25%	2'505'125.00	0.25	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	2'550	650	1'900 CHF	103.85%	1'973'150.00	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	2'000	400	1'600 CHF	101.25%	1'620'000.00	0.16	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	102.05%	2'449'200.00	0.25	a)
CH1256367207	2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN	0	3'100	400	2'700 CHF	102.50%	2'767'500.00	0.28	a)
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	3'800	750	3'050 CHF	102.15%	3'115'575.00	0.32	a)
CH1261608900	2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN	0	2'000	1'200	800 CHF	103.05%	824'400.00	0.08	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	4'200	300	3'900 CHF	101.10%	3'942'900.00	0.40	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	0	2'600	650	1'950 CHF	103.45%	2'017'275.00	0.20	a)
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	0	2'000	300	1'700 CHF	102.20%	1'737'400.00	0.18	a)
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	104.25%	1'146'750.00	0.12	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	2'100	350	1'750 CHF	105.55%	1'847'125.00	0.19	a)
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	4'645	300	4'345 CHF	101.70%	4'418'865.00	0.45	a)
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	4'150	800	3'350 CHF	105.10%	3'520'850.00	0.36	a)
CH1264823472	2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN	0	1'400	700	700 CHF	100.89%	706'230.00	0.07	a)
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	0	2'200	0	2'200 CHF	100.81%	2'217'820.00	0.22	a)
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	0	2'400	1'000	1'400 CHF	104.15%	1'458'100.00	0.15	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	0	3'000	400	2'600 CHF	102.55%	2'666'300.00	0.27	a)
CH1264823514	2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN	0	2'800	200	2'600 CHF	102.35%	2'661'100.00	0.27	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	0	1'200	0	1'200 CHF	100.85%	1'210'200.00	0.12	a)
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	3'100	700	2'400 CHF	101.65%	2'439'600.00	0.25	a)
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	0	2'300	300	2'000 CHF	101.65%	2'033'000.00	0.21	a)
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	0	2'300	200	2'100 CHF	104.10%	2'186'100.00	0.22	a)
CH1270825529	4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN	0	1'300	300	1'000 CHF	104.45%	1'044'500.00	0.11	a)
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	0	2'600	400	2'200 CHF	103.75%	2'282'500.00	0.23	a)
CH1271007952	2.3750 % HYN0E 2 3/8 01/26/29 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.10	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	3'100	600	2'500 CHF	102.95%	2'573'750.00	0.26	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	0	1'600	200	1'400 CHF	102.65%	1'437'100.00	0.15	a)
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	1'400	100	1'300 CHF	102.60%	1'333'800.00	0.14	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	0	1'500	600	900 CHF	101.35%	912'150.00	0.09	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	2'400	700	1'700 CHF	102.35%	1'739'950.00	0.18	a)
CH1271360575	1.7500 % AIIB 1 3/4 06/26/30	0	1'850	100	1'750 CHF	102.65%	1'796'375.00	0.18	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	1'700	800	900 CHF	102.60%	923'400.00	0.09	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	0	2'000	0	2'000 CHF	102.30%	2'046'000.00	0.21	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	1'400	550	850 CHF	101.85%	865'725.00	0.09	a)
CH1271360617	1.2125 % EBRD 1.2125 03/04/31 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	100.00%	1'800'000.00	0.18	a)
CH1271360625	2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28	0	2'855	250	2'605 CHF	103.65%	2'700'082.50	0.27	a)
CH1271360633	2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN	0	955	0	955 CHF	100.75%	962'162.50	0.10	a)
CH1271360641	2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN	0	1'900	0	1'900 CHF	100.65%	1'912'350.00	0.19	a)
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	101.50%	1'218'000.00	0.12	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	3'000	300	2'700 CHF	102.75%	2'774'250.00	0.28	a)
CH1273475421	2.3000 % ABNAV 2.3 06/26/25 EMTN	0	1'800	200	1'600 CHF	100.86%	1'613'760.00	0.16	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	1'300	450	850 CHF	102.05%	867'425.00	0.09	a)
CH1276269722	2.5050 % ABNAV 2.505 06/26/28	0	2'400	200	2'200 CHF	102.65%	2'258'300.00	0.23	a)
CH1276269730	2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN	0	2'450	400	2'050 CHF	105.15%	2'155'575.00	0.22	a)
CH1276269755	2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN	0	1'460	0	1'460 CHF	101.32%	1'479'272.00	0.15	a)
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	104.10%	1'769'700.00	0.18	a)
CH1276531253	1.6025 % AFDB 1.6025 07/05/28 EMTN	0	1'025	200	825 CHF	101.80%	839'850.00	0.09	a)
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	2'500	200	2'300 CHF	104.85%	2'411'550.00	0.24	a)
CH1277080508	1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN	0	2'500	0	2'500 CHF	104.70%	2'617'500.00	0.27	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	1'700	100	1'600 CHF	103.50%	1'656'000.00	0.17	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'400	100	1'300 CHF	105.25%	1'368'250.00	0.14	a)
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	102.00%	1'734'000.00	0.18	a)
CH1277582016	2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN	0	2'090	200	1'890 CHF	104.45%	1'974'105.00	0.20	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	2'850	200	2'650 CHF	101.60%	2'692'400.00	0.27	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	1'200	300	900 CHF	104.60%	941'400.00	0.10	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.15	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	2'000	155	1'845 CHF	101.55%	1'873'597.50	0.19	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	4'200	300	3'900 CHF	101.30%	3'950'700.00	0.40	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1280994299	2.9700 % Nwide 2.97 09/08/27 EMTN	0	1'600	0	1'600 CHF	102.35%	1'637'600.00	0.17	a)
CH1282304489	1.5525 % ASIA 1.5525 08/03/33 EMTN	0	1'200	200	1'000 CHF	103.00%	1'030'000.00	0.10	a)
CH1289657095	1.8750 % VORHYP 1 7/8 09/13/30 EMTN	0	1'500	300	1'200 CHF	101.95%	1'223'400.00	0.12	a)
CH1289657137	2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN	0	2'200	300	1'900 CHF	102.80%	1'953'200.00	0.20	a)
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	2'900	300	2'600 CHF	101.20%	2'631'200.00	0.27	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	0	1'900	300	1'600 CHF	102.60%	1'641'600.00	0.17	a)
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	101.75%	1'831'500.00	0.19	a)
CH1290870984	1.8225 % KOLAHO 1.8225 02/13/26 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	100.20%	1'402'800.00	0.14	a)
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	905	0	905 CHF	101.70%	920'385.00	0.09	a)
CH1290871008	2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN	0	3'500	0	3'500 CHF	101.52%	3'553'060.00	0.36	a)
CH1290871016	2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN	0	3'200	0	3'200 CHF	102.02%	3'264'736.00	0.33	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	100.47%	1'406'580.00	0.14	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	1'600	200	1'400 CHF	101.70%	1'423'800.00	0.14	a)
CH1291809908	2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	102.50%	1'742'500.00	0.18	a)
CH1291809916	2.5500 % EDF 2.55 09/12/31 EMTN	0	1'200	200	1'000 CHF	104.85%	1'048'500.00	0.11	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	2'460	300	2'160 CHF	101.25%	2'187'000.00	0.22	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	0	1'300	200	1'100 CHF	102.55%	1'128'050.00	0.11	a)
CH1293238007	2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN	0	1'300	300	1'000 CHF	101.45%	1'014'500.00	0.10	a)
CH1293714338	2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28	0	1'600	200	1'400 CHF	102.60%	1'436'400.00	0.15	a)
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	0	2'200	500	1'700 CHF	102.25%	1'738'250.00	0.18	a)
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	1'500	200	1'300 CHF	101.70%	1'322'100.00	0.13	a)
CH1294486357	2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN	0	1'700	300	1'400 CHF	102.55%	1'435'700.00	0.15	a)
CH1294486365	3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN	0	900	0	900 CHF	101.85%	916'650.00	0.09	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	1'400	200	1'200 CHF	100.95%	1'211'400.00	0.12	a)
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	0	1'300	200	1'100 CHF	102.45%	1'126'950.00	0.11	a)
CH1296276152	2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN	0	1'000	200	800 CHF	101.60%	812'800.00	0.08	a)
CH1296276160	2.7475 % ACHMEA 2.7475 10/16/30 EMTN	0	1'000	100	900 CHF	102.85%	925'650.00	0.09	a)
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	0	2'590	200	2'390 CHF	104.25%	2'491'575.00	0.25	a)
CH1298957064	2.6825 % SOCGGR 2.6825 10/19/29 EMTN	0	2'200	400	1'800 CHF	103.85%	1'869'300.00	0.19	a)
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	0	2'400	300	2'100 CHF	101.10%	2'123'100.00	0.22	a)
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	0	1'900	200	1'700 CHF	103.10%	1'752'700.00	0.18	a)
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	0	1'100	200	900 CHF	101.70%	915'300.00	0.09	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	2'100	300	1'800 CHF	101.95%	1'835'100.00	0.19	a)
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	0	1'200	200	1'000 CHF	102.75%	1'027'500.00	0.10	a)
CH1300950008	2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN	0	2'850	200	2'650 CHF	101.10%	2'679'150.00	0.27	a)
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	0	1'400	100	1'300 CHF	102.90%	1'337'700.00	0.14	a)
CH1300950032	2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	100.55%	2'413'200.00	0.24	a)
CH1305916749	1.5600 % AUCCCN 1.56 11/30/29 EMTN	0	1'400	400	1'000 CHF	100.90%	1'009'000.00	0.10	a)
CH1305916889	2.2150 % GLENLN 2.215 01/18/30 EMTN	0	1'600	250	1'350 CHF	100.35%	1'354'725.00	0.14	a)
CH1305916905	1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN	0	1'700	0	1'700 CHF	100.25%	1'704'250.00	0.17	a)
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	0	2'100	0	2'100 CHF	99.15%	2'082'150.00	0.21	a)
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	0	1'100	250	850 CHF	100.20%	851'700.00	0.09	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	0	2'000	0	2'000 CHF	100.40%	2'008'000.00	0.20	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	1'600	300	1'300 CHF	101.20%	1'315'600.00	0.13	a)
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	102.25%	2'965'250.00	0.30	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	100.05%	2'401'200.00	0.24	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	1'500	0	1'500 CHF	100.65%	1'509'750.00	0.15	a)
CH1321481538	2.5000 % MUNHYP 2 1/2 02/20/30 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	101.05%	1'414'700.00	0.14	a)
CH1321481546	2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	101.00%	1'414'000.00	0.14	a)
CH1321737780	2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN	0	1'900	500	1'400 CHF	101.25%	1'417'500.00	0.14	a)
CH1322499612	2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN	0	2'275	0	2'275 CHF	100.98%	2'297'363.25	0.23	a)
CH1322499620	2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN	0	2'620	0	2'620 CHF	102.60%	2'688'041.40	0.27	a)
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	0	1'300	0	1'300 CHF	100.00%	1'300'000.00	0.13	a)
CH1325807845	2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30	0	1'300	0	1'300 CHF	100.15%	1'301'950.00	0.13	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	100.31%	2'909'106.00	0.29	a)
CH1325807886	2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN	0	2'600	0	2'600 CHF	100.61%	2'615'964.00	0.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1325807902	2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN	0	2'400	0	2'400 CHF	100.44%	2'410'464.00	0.24	a)
CH1331113477	1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28	0	2'200	0	2'200 CHF	100.45%	2'209'921.78	0.22	a)
CH1331113485	1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32	0	2'900	0	2'900 CHF	100.77%	2'922'446.00	0.30	a)
CH1331113493	2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36	0	2'200	0	2'200 CHF	101.28%	2'228'204.00	0.23	a)
CHF							977'512'658.43	99.01	

Vermögensaufstellung		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		4'105'346.35	0.42
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		977'512'658.43	99.01
Sonstige Vermögenswerte		5'713'510.38	0.58
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		987'331'515.16	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-6'597.02	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		987'324'918.14	

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);	977'512'658.43	99.01
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	203'904'891.00	20.65
------------------------------	-----------------------	--------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		203'904'891.00	20.65		
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	6'100 CHF	121.50%	7'411'500.00	0.75
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	1'100 CHF	121.10%	1'332'100.00	0.13
CH0026302304	3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN	500 CHF	112.50%	562'500.00	0.06
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	500 CHF	111.15%	555'750.00	0.06
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'500 CHF	115.95%	1'739'250.00	0.18
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	650 CHF	123.05%	799'825.00	0.08
CH0109156262	2.7500 % ASIA 2 3/4 02/12/30 EMTN	1'510 CHF	108.85%	1'643'635.00	0.17
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	500 CHF	102.70%	513'500.00	0.05
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	500 CHF	101.80%	509'000.00	0.05
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	3'025 CHF	100.85%	3'050'712.50	0.31
CH0198415074	4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN	1'000 CHF	108.10%	1'081'000.00	0.11
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	1'100 CHF	104.10%	1'145'100.00	0.12
CH0253514761	1.3750 % BATSLN 1 3/8 09/08/26 EMTN	2'000 CHF	99.20%	1'984'000.00	0.20
CH0282018982	0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN	650 CHF	97.40%	633'100.00	0.06
CH0282344339	1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN	900 CHF	99.77%	897'930.00	0.09
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	4'500 CHF	97.65%	4'394'250.00	0.45
CH0292984454	2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN	105 CHF	100.55%	105'577.50	0.01
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	1'000 CHF	98.70%	987'000.00	0.10
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	500 CHF	97.85%	489'250.00	0.05
CH0303138520	0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN	500 CHF	97.80%	489'000.00	0.05
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	2'100 CHF	97.45%	2'046'450.00	0.21
CH0305558030	1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28	1'800 CHF	98.60%	1'774'800.00	0.18
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	1'000 CHF	97.45%	974'500.00	0.10
CH0315955937	0.5100 % CAF 0.51 09/16/26 EMTN	800 CHF	96.50%	772'000.00	0.08
CH0319415995	0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN	1'500 CHF	97.15%	1'457'250.00	0.15
CH0323735602	0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN	530 CHF	96.55%	511'715.00	0.05
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	500 CHF	96.55%	482'750.00	0.05
CH0341725866	0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN	150 CHF	95.85%	143'775.00	0.01
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	1'600 CHF	97.55%	1'560'800.00	0.16
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	1'500 CHF	91.15%	1'367'250.00	0.14
CH0367206759	0.2500 % ONT 0 1/4 06/28/29 EMTN	1'000 CHF	94.45%	944'500.00	0.10
CH0382451646	0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN	800 CHF	98.15%	785'200.00	0.08

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	1'000 CHF	97.85%	978'500.00	0.10
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	500 CHF	83.70%	418'500.00	0.04
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	1'500 CHF	95.85%	1'437'750.00	0.15
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	500 CHF	98.22%	491'100.00	0.05
CH0419041535	0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN	900 CHF	92.25%	830'250.00	0.08
CH0423233557	0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN	2'500 CHF	96.50%	2'412'500.00	0.24
CH0423279303	1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN	810 CHF	98.71%	799'551.00	0.08
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	1'200 CHF	97.55%	1'170'600.00	0.12
CH0429659607	1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN	2'150 CHF	99.25%	2'133'875.00	0.22
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	2'350 CHF	97.70%	2'295'950.00	0.23
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	1'000 CHF	82.00%	820'000.00	0.08
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	1'500 CHF	97.90%	1'468'500.00	0.15
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	2'000 CHF	98.15%	1'963'000.00	0.20
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	1'000 CHF	92.35%	923'500.00	0.09
CH0474977714	0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN	1'000 CHF	97.10%	971'000.00	0.10
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	1'000 CHF	92.85%	928'500.00	0.09
CH0483180953	0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN	1'625 CHF	97.80%	1'589'250.00	0.16
CH0494734350	0.3500 % GLENLN 0.35 09/10/25 EMTN	2'300 CHF	97.80%	2'249'400.00	0.23
CH0494734376	0.2500 % BCICI 0 1/4 09/24/29 EMTN	500 CHF	89.00%	445'000.00	0.05
CH0496632628	0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN	500 CHF	89.00%	445'000.00	0.05
CH0498400578	0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN	1'750 CHF	95.95%	1'679'125.00	0.17
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	1'200 CHF	95.90%	1'150'800.00	0.12
CH0498589024	0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN	1'000 CHF	92.00%	920'000.00	0.09
CH0505011947	0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN	2'000 CHF	94.40%	1'888'000.00	0.19
CH0506071148	0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN	500 CHF	96.70%	483'500.00	0.05
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	850 CHF	94.00%	799'000.00	0.08
CH0512502995	0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN	1'400 CHF	91.85%	1'285'900.00	0.13
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	2'600 CHF	90.65%	2'356'900.00	0.24
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	1'500 CHF	92.90%	1'393'500.00	0.14
CH0521333655	0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN	2'010 CHF	91.50%	1'839'150.00	0.19
CH0521617339	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN	1'400 CHF	95.25%	1'333'500.00	0.14
CH0522158911	0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN	1'100 CHF	95.75%	1'053'250.00	0.11
CH0522159026	2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN	900 CHF	100.40%	903'600.00	0.09
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	1'100 CHF	88.20%	970'200.00	0.10
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	800 CHF	98.76%	790'080.00	0.08
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	1'350 CHF	91.50%	1'235'250.00	0.13
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	2'500 CHF	92.95%	2'323'750.00	0.24
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	2'400 CHF	97.95%	2'350'800.00	0.24
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	1'420 CHF	95.10%	1'350'420.00	0.14
CH0581947808	0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN	3'600 CHF	85.40%	3'074'400.00	0.31
CH0593641027	0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN	800 CHF	93.10%	744'800.00	0.08
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	600 CHF	94.65%	567'900.00	0.06
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	500 CHF	89.30%	446'500.00	0.05
CH0598928726	0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN	600 CHF	90.35%	542'100.00	0.05
CH0598928742	0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN	900 CHF	88.90%	800'100.00	0.08
CH1105672666	0.5550 % VZ 0.555 03/24/31	1'850 CHF	92.50%	1'711'250.00	0.17
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	1'320 CHF	90.70%	1'197'240.00	0.12
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	1'000 CHF	88.25%	882'500.00	0.09
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	3'900 CHF	94.40%	3'681'600.00	0.37
CH1112011577	0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN	1'350 CHF	94.25%	1'272'375.00	0.13
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	1'500 CHF	90.60%	1'359'000.00	0.14
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	1'500 CHF	94.10%	1'411'500.00	0.14
CH1120085670	0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN	2'350 CHF	93.65%	2'200'775.00	0.22
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	400 CHF	89.35%	357'400.00	0.04
CH1121837236	0.2000 % DLR 0.2 12/15/26	500 CHF	95.10%	475'500.00	0.05
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	1'000 CHF	83.10%	831'000.00	0.08
CH1132966289	0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN	1'700 CHF	88.15%	1'498'550.00	0.15
CH1135555592	0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN	1'000 CHF	91.35%	913'500.00	0.09

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH1137122771	0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN	1'400 CHF	91.70%	1'283'800.00	0.13	
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	1'000 CHF	92.85%	928'500.00	0.09	
CH1137122847	0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN	1'000 CHF	94.50%	945'000.00	0.10	
CH1137407420	0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN	500 CHF	92.75%	463'750.00	0.05	
CH1139995802	0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN	500 CHF	94.80%	474'000.00	0.05	
CH1142700363	0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN	250 CHF	95.25%	238'125.00	0.02	
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	500 CHF	92.95%	464'750.00	0.05	
CH1146382499	0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN	500 CHF	93.75%	468'750.00	0.05	
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	1'550 CHF	93.05%	1'442'275.00	0.15	
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	1'000 CHF	92.10%	921'000.00	0.09	
CH1148308740	0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN	1'500 CHF	92.15%	1'382'250.00	0.14	
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	1'000 CHF	97.25%	972'500.00	0.10	
CH1167887277	0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN	1'800 CHF	99.11%	1'783'980.00	0.18	
CH1179534974	1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN	1'400 CHF	99.30%	1'390'200.00	0.14	
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	500 CHF	99.40%	497'000.00	0.05	
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	1'450 CHF	100.10%	1'451'450.00	0.15	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	1'000 CHF	98.40%	984'000.00	0.10	
CH1184694789	1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN	1'550 CHF	99.35%	1'539'925.00	0.16	
CH1187520460	1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN	1'000 CHF	99.05%	990'500.00	0.10	
CH1187520486	1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN	850 CHF	100.15%	851'275.00	0.09	
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	500 CHF	98.85%	494'250.00	0.05	
CH1204175124	1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN	3'400 CHF	100.10%	3'403'400.00	0.34	
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	2'230 CHF	98.75%	2'202'125.00	0.22	
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	500 CHF	100.50%	502'500.00	0.05	
CH1215933958	3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN	400 CHF	102.90%	411'600.00	0.04	
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	500 CHF	100.75%	503'750.00	0.05	
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	950 CHF	104.00%	988'000.00	0.10	
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	1'500 CHF	99.85%	1'497'750.00	0.15	
CH1228837899	2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN	700 CHF	101.25%	708'750.00	0.07	
CH1230759552	2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN	500 CHF	102.60%	513'000.00	0.05	
CH1231312690	2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN	500 CHF	101.50%	507'500.00	0.05	
CH1233900013	2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN	1'050 CHF	101.05%	1'061'025.00	0.11	
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	650 CHF	99.50%	646'750.00	0.07	
CH1243018814	2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN	500 CHF	102.45%	512'250.00	0.05	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	2'000 CHF	101.35%	2'027'000.00	0.21	
CH1244731795	2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN	150 CHF	100.80%	151'200.00	0.02	
CH1248666948	2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN	1'400 CHF	101.10%	1'415'400.00	0.14	
CH1248666955	2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN	2'250 CHF	103.40%	2'326'500.00	0.24	
CH1248666963	2.8925 % BCICI 2.8925 03/22/28 EMTN	1'200 CHF	102.30%	1'227'600.00	0.12	
CH1249416012	2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN	1'000 CHF	102.20%	1'022'000.00	0.10	
CH1249416020	1.9925 % STAACA 1.9925 03/14/33 EMTN	500 CHF	103.85%	519'250.00	0.05	
CH1251030099	2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN	1'400 CHF	101.90%	1'426'600.00	0.14	
CH1251030115	2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN	1'500 CHF	103.30%	1'549'500.00	0.16	
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	500 CHF	101.25%	506'250.00	0.05	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	3'050 CHF	102.15%	3'115'575.00	0.32	
CH1261608934	2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN	500 CHF	102.20%	511'000.00	0.05	
CH1264414322	3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN	500 CHF	104.25%	521'250.00	0.05	
CH1264823480	2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN	2'200 CHF	100.81%	2'217'820.00	0.22	
CH1264823498	2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN	1'000 CHF	104.15%	1'041'500.00	0.11	
CH1270825503	2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN	2'000 CHF	101.65%	2'033'000.00	0.21	
CH1270825511	2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN	500 CHF	104.10%	520'500.00	0.05	
CH1270825545	2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN	1'000 CHF	103.75%	1'037'500.00	0.11	
CH1271007952	2.3750 % HYNOE 2 3/8 01/26/29 EMTN	1'000 CHF	101.15%	1'011'500.00	0.10	
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	800 CHF	102.65%	821'200.00	0.08	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	500 CHF	102.60%	513'000.00	0.05	
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	500 CHF	102.60%	513'000.00	0.05	
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	2'000 CHF	102.30%	2'046'000.00	0.21	
CH1273429691	2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN	600 CHF	101.50%	609'000.00	0.06	
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	500 CHF	102.75%	513'750.00	0.05	
CH1273475421	2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN	1'600 CHF	100.86%	1'613'760.00	0.16	
CH1276269722	2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28	400 CHF	102.65%	410'600.00	0.04	
CH1276269755	2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN	1'000 CHF	101.32%	1'013'200.00	0.10	
CH1276269763	2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN	500 CHF	104.10%	520'500.00	0.05	
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	2'280 CHF	104.85%	2'390'580.00	0.24	
CH1277582008	2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN	500 CHF	102.00%	510'000.00	0.05	
CH1290870976	2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN	400 CHF	101.75%	407'000.00	0.04	
CH1294486324	2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN	1'000 CHF	102.25%	1'022'500.00	0.10	
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	1'300 CHF	101.70%	1'322'100.00	0.13	
CH1296276160	2.7475 % ACHMEA 2.7475 10/16/30 EMTN	500 CHF	102.85%	514'250.00	0.05	
CH1298665980	2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN	2'000 CHF	104.25%	2'085'000.00	0.21	
CH1298957064	2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN	1'300 CHF	103.85%	1'350'050.00	0.14	
CH1300224875	1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN	2'000 CHF	101.10%	2'022'000.00	0.20	
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	790 CHF	103.10%	814'490.00	0.08	
CH1300277733	2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN	125 CHF	101.70%	127'125.00	0.01	
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	1'000 CHF	102.75%	1'027'500.00	0.10	
CH1300950016	2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN	500 CHF	102.90%	514'500.00	0.05	
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	500 CHF	99.15%	495'750.00	0.05	
CH1314941381	2.1250 % VORHYP 2 1/8 07/23/27 EMTN	500 CHF	100.20%	501'000.00	0.05	
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	500 CHF	100.40%	502'000.00	0.05	
CH1321113453	2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN	300 CHF	102.25%	306'750.00	0.03	
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	1'500 CHF	100.65%	1'509'750.00	0.15	
CH1321481538	2.5000 % MUNHYP 2 1/2 02/20/30 EMTN	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.10	
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	1'300 CHF	100.00%	1'300'000.00	0.13	

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	11'785'347.99	5.443
Bond	CHF	204'691'712.75	94.539
Equity	CHF	38'656.32	0.018
Total	CHF	216'515'717.06	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.49	-	0.109	0.00 - 0.05	-	0.002
FA CHF	CHF	0.00 - 0.49	-	0.109	0.00 - 0.05	-	0.002
GT CHF	CHF	0.00 - 0.49	-	0.109	0.00 - 0.05	-	0.002
NT CHF	CHF	0.00 - 0.49	-	0.109	0.00 - 0.05	-	0.002

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.

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	203'904'891.00
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	3.000
FA CHF	0.160	0.500	0.060	0.100	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000

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

9 Benchmark

SBI® Foreign AAA-BBB Index TR

10 TER

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

11 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024 **Ausschüttung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Ja	CHF	0.85000	0.29750	0.55250

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024 **Thesaurierung an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	1.020	0.357	0.663
GT CHF	Ja	CHF	0.92971	0.32539	0.60432
NT CHF	Ja	CHF	1.202	0.420	0.782

13 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. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG} \text{ (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um 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 Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund 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 Europe ex CH Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 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
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
(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

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

In Teil 2 dieser Veröffentlichung werden zusätzlichen Fondsvertragsänderungen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert. Dabei sollen folgende Anpassungen vorgenommen werden:

- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll künftig als Zielfonds von einer anderen kollektiven Kapitalanlage der Swisscanto Fondsleitung AG dienen (vgl. Teil 2, Ziff. 1 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll in diesem Zusammenhang daher ebenfalls repositioniert werden (vgl. Teil 2, Ziff. 2 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll umbenannt und der Referenzindex soll gleichzeitig angepasst werden (vgl. Teil 2, Ziff. 3 dieser Veröffentlichung)
- Vereinigungen von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (siehe dazu die Ausführungen unter Teil 2, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgende Vereinigung des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen	Übernehmendes Teilvermögen	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	25. Juli 2023

2 Begründung für die Vereinigung

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist in § 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Der Fondsvertrag der zu vereinigenden Teilvermögen stimmt nach der Durchführung der in Bst. II. dieser Veröffentlichung beantragten Änderungen des Fondsvertrages der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen werden auf den gleichen Tag bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Bst. II dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages wird mit Wirkung per 25. Juli 2023 das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

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

Im Rahmen der Vereinigung werden die Anteile der Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übertragenden Teilvermögens in Anteile der neu zu eröffnenden Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übernehmenden Teilvermögens bei der Vereinigung per 25. Juli 2023 umgetauscht. Zudem werden per 25. Juli 2023 Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Massnahme	Datum des Umtausches oder der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)		
FA CHF	FA CHF	Umtausch	25. Juli 2023
DT CHF	FA CHF	Vereinigung	25. Juli 2023
GT CHF	GT CHF	Umtausch	25. Juli 2023
NT CHF	NT CHF	Umtausch	25. Juli 2023

Am Mittwoch, 26. Juli 2023, wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse per Dienstag, 25. Juli 2023, durchgeführt. Am Mittwoch, 26. Juli 2023 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf Dienstag, 25. Juli 2023 (Vereinigungsstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 22. März 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

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

7 Kosten

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

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	21. Juli 2023 bis 26. Juli 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

II Änderungen im Fondsvertrag

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

In § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF nach bildet. Bis anhin war der FTSE Non-CHF World Government Bond Index der massgebende Referenzindex.

Teil 2 – Repositionierungen bei Teilvermögen, Umbenennung der Bezeichnung bei einem Teilvermögen und Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

1 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll neu als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF (neu beantragte Bezeichnung Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I), vgl. nachstehende Ziff. 3 dieser Veröffentlichung) dienen. Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 21, § 15 Ziff. 13 und 22 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen des Teilvermögens bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds fungiert, soll gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des Zielfonds erwerben können (vgl. dazu die erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages).

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgebliche investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anlegerinnen und 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 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. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF als investierende kollektive Kapitalanlage

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll neu in den Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren können. In diesem Zusammenhang wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren darf (vgl. die Anpassungen in § 8 Ziff. 21 sowie § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages).

Betreffend die weiteren für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF aufgenommenen Anpassungen in § 15 Ziff. 13, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1, welche zum Ziel haben, dass das Teilvermögen in den Zielfonds investieren kann, wird auf die obenstehenden Ausführungen in Ziff. 1 dieser Veröffentlichung verwiesen.

In § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages wird zudem eine neue Bestimmung aufgenommen, wonach die Fondsleitung für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien desselben Zielfonds angelegt werden darf.

3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF sowie entsprechende Anpassung in der Anlagepolitik

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 23 und 27 (nach Vereinigung neue Ziff. 26), § 15 Ziff. 3, 13 und 22, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages)

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird auch der Referenzindex entsprechend in § 8 Ziff. 26 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index.

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

Per 25. Juli 2023 werden Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt (vgl. unsere Ausführungen in Teil 1, I, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)	
DT CHF	FA CHF	25. Juli 2023

Im Nachgang zur Vereinigung der Teilvermögen werden per 10. August 2023 die Anteile der Klasse DTH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FAH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
FAH1 CHF	DTH1 CHF	10. August 2023

Die jeweilige übertragende Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens wird gemäss der vorstehenden Tabelle, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, mit der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens vereinigt. Das Umtauschverhältnis für den Umtausch von Anteilen der jeweiligen übertragenden Anteilsklasse in Anteile der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse wird jeweils nach Durchführung der Vereinigung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds (www.fundinfo.com) veröffentlicht.

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

Für das nachgenannte Teilvermögen sind die folgenden Anteilsklassen im angepassten Fondsvertrag nicht mehr vorgesehen (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages):

Teilvermögen	Anteilsklassen
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD

* * *

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

zwei Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 25. Juli 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 25. Juli 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens auch für das übertragende Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 25. Juli 2023:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)			Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)		
	ISIN	NAV pro Anteil		ISIN	NAV pro Anteil
FA CHF	CH0315621307	70.93	FA CHF	CH1270020246	70.93
DT CHF	CH0117045291	79.46	FA CHF	CH1270020246	70.93
GT CHF	CH0342828479	76.10	GT CHF	CH1270020279	76.10
NT CHF	CH0117045283	80.75	NT CHF	CH1270020295	80.75

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergibt sich das folgende Umtauschverhältnis jeweils aus Sicht des übertragenden Teilvermögens (1 Anteil des übertragenden Teilvermögens ↔ Anzahl Anteile am übernehmenden Teilvermögen):

Swisscanto (CH) Pension Equity Fund Responsible Europe ex CH (übertragendes Teilvermögen)	
Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
FA CHF	1 ↔ 1.0000000000
DT CHF	1 ↔ 1.1202372991
GT CHF	1 ↔ 1.0000000000
NT CHF	1 ↔ 1.0000000000

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 8. August 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) per 25. Juli 2023 geprüft.

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

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

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung der oben erwähnten Teilvermögen korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt."

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

(nachfolgend das "Teilvermögen")

ein Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

Die mit Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds angekündigte Vereinigung von Anteilsklassen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds wurde vollzogen.

Nachstehend wird für das genannte Teilvermögen das Umtauschverhältnis für die Vereinigung der übertragenden Anteilsklasse mit der übernehmenden Anteilsklasse basierend auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 10. August 2023 aufgeführt.

Anteilsklasse DTH1 CHF (übertragende)			Anteilsklasse FAH1 CHF (übernehmende)			
Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil	Umtauschverhältnis	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
DTH1 CHF	CH0117045325	93.42	1 ↔ 1.2900884308	FAH1 CHF	CH0315621315	72.41

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass die Frist zur Erhebung von Einwendungen gegen die oben erwähnte Vereinigung von Anteilsklassen abgelaufen ist und Einwendungen gegen diese Vereinigung nicht mehr möglich sind.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

betreffend

Einstellung von Zeichnungen und Aufschub von Rückzahlungen von Anteilen des folgenden Teilvermögens des oben genannten Umbrella-Fonds

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) investiert einen wesentlichen Anteil seines Fondsvermögens in neun Teilvermögen (Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.) des Umbrella-Fonds *Swisscanto (CH) Index Fund II*, bei welchen im Rahmen der Vereinigung mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während einzelner Tage Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden (vgl. die Publikation vom 18. September 2023 betreffend den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Dies hat zur Folge, dass beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während des folgenden Zeitraums Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden:

Teilvermögen	Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	20. November 2023 bis 24. November 2023

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

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die 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 World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist die Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem wird bei 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 und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung).

Es werden überdies bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect Änderungen in den bestehenden Gating-Bestimmungen vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.2 dieser Veröffentlichung).

Neben den in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden zusätzlich einzelne Anpassungen formeller Natur vorgenommen.

1 Änderungen der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, soll gestrichen werden.

2 Gating-Verfahren

2.1 Einführung Gating-Verfahren bei 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 und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Bei den oben aufgeführten Teilvermögen werden neue Bestimmungen betreffend Gating aufgenommen (vgl. Ziff. 8 und Ziff. 9 in § 17 des angepassten Fondsvertrages).

Die Fondsleitung behält sich bei den nachstehend (in Ziff. 9 von § 17 des angepassten Fondsvertrages) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung angegeben (vgl. §17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages). Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Gleichsam behält sich die Fondsleitung bei den (unter Ziff. 9 von § 17) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen vorhandenen Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung (vgl. Ziff. 9 von § 17) angegeben. Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt (vorbehältlich § 17 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie § 5 Ziff. 8 des Fondsvertrages). Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

In § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages werden die Teilvermögen mit Gating bei einem Rücknahmeüberhang bzw. Zeichnungsüberhang mit entsprechenden **Mindest-Schwellenwerten** aufgeführt. Bei den nachstehenden Teilvermögen sind folgende Werte massgebend:

– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)	mind.	CHF 120'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible	mind.	CHF 100'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland	mind.	CHF 20'000'000
– Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible	mind.	CHF 20'000'000

Bei den im Prospekt in Ziff. 1.8 angegeben **effektiven Schwellenwerten** sind folgende Werte massgebend:

– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)	CHF 120'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible	CHF 100'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland	CHF 25'000'000
– Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible	CHF 60'000'000

2.2 Änderung des Gating-Verfahrens bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Bei den oben aufgeführten Teilvermögen bestehen bereits Bestimmungen betreffend Gating, welche neu umfassend angepasst werden (vgl. Ziff. 8 und Ziff. 9 in § 17 des angepassten Fondsvertrages).

Die Fondsleitung behält sich bei den nachstehend (in Ziff. 9 von § 17 des angepassten Fondsvertrages) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung angegeben (vgl. § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages). Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Gleichsam behält sich die Fondsleitung bei den (unter Ziff. 9 von § 17) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen vorhandenen Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung (vgl. Ziff. 9 von § 17) angegeben. Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt (vorbehältlich § 17 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie § 5 Ziff. 8 des Fondsvertrages). Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

In § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages werden die Teilvermögen mit Gating bei einem Rücknahmeüberhang bzw. Zeichnungsüberhang mit entsprechenden **Mindest-Schwellenwerten** aufgeführt. Bei den nachstehenden Teilvermögen sind folgende Werte massgebend:

- | | | |
|---|-------|-----------------|
| – Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. | mind. | CNY 400'000'000 |
| – Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect | mind. | CHF 10'000'000 |

Bei den im Prospekt in Ziff. 1.8 angegeben **effektiven Schwellenwerten** sind folgende Werte massgebend:

- | | |
|---|-------------------|
| – Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. | CNY 1'200'000'000 |
| – Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect | CHF 10'000'000 |

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser

Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 23. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die 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 World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Mit Veröffentlichung vom 23. November 2023 wurden, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, von der Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, diverse Anpassungen des Fondsvertrages beantragt.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist unter anderem die **Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH**. Diese Anpassung beabsichtigt, dass die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, gestrichen werden soll (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 der Veröffentlichung vom 23. November 2023).

In Zusammenhang mit der geplanten Änderung wird in der gleichen Bestimmung (in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages) zudem neu die Regelung ergänzt, dass Investitionen in Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich