

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND EMU GOVT.

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
FA EUR	31562120	EUR
FAH1 CHF	121592640	CHF
GT EUR	55960171	EUR
GTH1 CHF	121592641	CHF
NT EUR	11704515	EUR
NTH1 CHF	59570849	CHF

Rechnungswährung: EUR

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 beigegefügte 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	18
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	19
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	19
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	19
8	Pauschale Verwaltungskommission	20
9	Benchmark	20
10	TER	20
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	21
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	21
13	Fussnoten	21
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	22
15	Pflichtpublikationen	24

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					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		725'605'004.51	119'453'366.14	418'783'066.93	380'072'397.76
Klasse FA EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'440'871.87	8'495'874.88	14'263'535.05	11'667'915.71
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		132'323.434	111'261.796	154'231.124	119'147.418
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		78.9042	76.3593	92.4816	97.9284
Ausschüttung je Anteil		1.35	1.40	1.40	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse FAH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		62'492.70	9'783.09		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		600.000	100.000		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.2471	97.2395		
Ausschüttung je Anteil (in EUR)		1.75	0.65		
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %		
Klasse GT EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		36'711'878.41	29'270'642.95	289'997'544.23	270'288'410.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		441'436.345	368'188.946	3'046'843.296	2'711'271.644
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.1646	79.4990	95.1797	99.6906
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		79.2462	79.0184	98.0811	109.5452
Thesaurierung je Anteil		1.44	1.43	1.48	1.71
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse GTH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)			9'784.96		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode			100.000		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)			97.2581		
Thesaurierung je Anteil (in EUR)			0.70		
Total Expense Ratio (TER)			0.16 %		
Klasse NT EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		663'338'221.84	68'562'406.76	99'289'904.40	83'327'622.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'678'390.077	613'787.931	743'039.337	595'880.028
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		116.8180	111.7037	133.6267	139.8396
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		111.3139	111.0285	137.7002	153.6630
Thesaurierung je Anteil		1.80	2.17	2.27	2.62
Zwischenausschüttung je Anteil		0.39	-	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in EUR)		15'051'539.69	13'104'873.50	15'232'083.25	14'788'449.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		179'691.664	166'865.802	166'865.802	165'725.682
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		79.8165	78.0607	94.0661	98.0555
Thesaurierung je Anteil (in EUR)		1.57	1.53	1.48	0.11
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA EUR	5.22 %	7.05 %	-18.48 %	-3.63 %
Klasse FAH1 CHF (Lancierung 30.09.2022)	2.73 %	4.77 %	-2.66 %	-
Klasse GT EUR	5.26 %	7.09 %	-18.43 %	-3.59 %
Klasse GTH1 CHF (Lancierung 30.09.2022, Schliessung 28.02.2023)	-	-0.10 %	-2.64 %	-
Klasse NT EUR	5.41 %	7.24 %	-18.32 %	-3.46 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	2.93 %	4.98 %	-18.79 %	-3.15 %
Benchmark Hedge	2.85 %	4.91 %	-	-
Benchmark	5.28 %	7.16 %	-18.52 %	-3.54 %
Tracking Error 33)	0.08 %	0.08 %	0.15 %	0.08 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FA EUR	-0.06 %
Klasse FAH1 CHF (Lancierung 30.09.2022)	-0.12 %
Klasse GT EUR	-0.02 %
Klasse NT EUR	0.13 %
Klasse NTH1 CHF (Lancierung 29.01.2021)	0.08 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'424'621.57	349'655.88
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	716'966'166.01	117'955'583.21
Sonstige Vermögenswerte	7'219'814.19	1'152'728.90
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	725'610'601.77	119'457'967.99
Andere Verbindlichkeiten	-5'597.26	-4'601.85
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	725'605'004.51	119'453'366.14

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse FA EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		111'261.796	154'231.124
Ausgegebene Anteile		68'634.562	7'679.645
Zurückgenommene Anteile		-47'572.924	-50'648.973
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		132'323.434	111'261.796

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	Lancierung 30.09.2022 28.02.2023
Klasse FAH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		100.000	-
Ausgegebene Anteile		500.000	100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		600.000	100.000

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse GT EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		368'188.946	3'046'843.296
Ausgegebene Anteile		3'681'054.741	63'236.350
Zurückgenommene Anteile		-3'607'807.342	-2'741'890.700
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		441'436.345	368'188.946

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	Lancierung 30.09.2022 28.02.2023
Klasse GTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		100.000	-
Ausgegebene Anteile		-	100.000
Zurückgenommene Anteile		-100.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	100.000

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse NT EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		613'787.931	743'039.337
Ausgegebene Anteile		435'905.833	9'190.227
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		4'851'455.503	-
Zurückgenommene Anteile		-222'759.190	-138'441.633
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'678'390.077	613'787.931

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		166'865.802	166'865.802
Ausgegebene Anteile		12'825.862	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		179'691.664	166'865.802

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		119'453'366.14	418'783'066.93
Ausbezahlte Ausschüttung		-219'239.86	-178'554.03
Zwischenausschüttung		-83'222.33	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'420'656.46	-822'109.80
Saldo aus dem Anteilverkehr		582'791'369.28	-274'864'747.60
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		26'083'387.74	-23'464'289.36
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		725'605'004.51	119'453'366.14

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		25'933.79	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-1'039.56
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		7'536'939.11	2'445'065.35
Erträge aus Wertpapierleihe		33'928.22	18'423.44
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds		5'557'088.27	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'242'559.33	54'191.73
Total Ertrag		14'396'448.72	2'516'640.96
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-2.42
Reglementarische Vergütungen		-224'901.94	-69'917.42
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'600'147.69	-181'679.44
Total Aufwand		-2'825'049.63	-251'599.28
Nettoertrag / Verlust		11'571'399.09	2'265'041.68
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-20'875'496.42	-1'751'052.69
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		446'344.30	5'864.32
Realisierter Erfolg		-8'857'753.03	519'853.31
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		34'941'140.77	-23'984'142.67
Gesamterfolg		26'083'387.74	-23'464'289.36

Verwendung des Erfolges

Klasse FA EUR	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	179'203.94	145'714.58
Vortrag des Vorjahres	4'719.03	14'770.96
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	183'922.97	160'485.54
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	178'636.64	155'766.51
Vortrag auf neue Rechnung	5'286.33	4'719.03
Total	183'922.97	160'485.54
Klasse FAH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	1'071.02	68.47
Vortrag des Vorjahres	3.47	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'074.49	68.47
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'050.00	65.00
Vortrag auf neue Rechnung	24.49	3.47
Total	1'074.49	68.47
Klasse GT EUR	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	638'955.69	526'826.90
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	638'955.69	526'826.90
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	223'634.49	184'389.42
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	415'321.20	342'437.48
Total	638'955.69	526'826.90
Klasse GTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	0.00	70.39
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	70.39
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	24.64
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	45.75
Total	0.00	70.39
Klasse NT EUR	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	10'469'173.11	1'336'390.61
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10'469'173.11	1'336'390.61
Zwischenausschüttung	237'778.08	0.00
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'580'988.26	467'736.71
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'650'406.77	868'653.90
Total	10'469'173.11	1'336'390.61
Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	282'995.33	255'970.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	282'995.33	255'970.73
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	99'048.37	89'589.76
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	183'946.96	166'380.97
Total	282'995.33	255'970.73

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 EUR	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							716'966'166.01	98.81	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							716'966'166.01	98.81	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	174	1'175	420	929 EUR	110.68%	1'028'198.62	0.14	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	306	1'903	640	1'569 EUR	111.57%	1'750'580.37	0.24	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	219	1'469	580	1'108 EUR	103.42%	1'145'893.60	0.16	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	90	550	170	470 EUR	114.71%	539'137.00	0.07	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	168	1'111	410	869 EUR	100.31%	871'693.90	0.12	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	154	1'240	400	994 EUR	95.42%	948'474.80	0.13	a)
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	245	430	675	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	267	1'532	545	1'254 EUR	96.97%	1'216'003.80	0.17	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	284	2'142	590	1'836 EUR	94.72%	1'739'004.12	0.24	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	145	1'359	400	1'104 EUR	73.72%	813'835.68	0.11	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	63	322	100	285 EUR	58.72%	167'352.00	0.02	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	275	1'845	540	1'580 EUR	93.09%	1'470'822.00	0.20	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	128	773	240	661 EUR	75.57%	499'517.70	0.07	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	257	1'457	460	1'254 EUR	92.52%	1'160'200.80	0.16	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	204	1'891	590	1'505 EUR	89.55%	1'347'727.50	0.19	a)
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	265	430	695	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	272	1'751	550	1'473 EUR	84.96%	1'251'460.80	0.17	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	157	1'223	350	1'030 EUR	57.96%	596'988.00	0.08	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	95	602	180	517 EUR	45.67%	236'113.90	0.03	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	126	813	290	649 EUR	60.09%	389'984.10	0.05	a)
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	238	1'944	600	1'582 EUR	82.39%	1'303'409.80	0.18	a)
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	84	465	190	359 EUR	44.22%	158'749.80	0.02	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	165	1'035	350	850 EUR	96.30%	818'550.00	0.11	a)
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	138	976	230	884 EUR	70.91%	626'844.40	0.09	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	84	1'408	470	1'022 EUR	88.18%	901'199.60	0.12	a)
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	100	1'676	490	1'286 EUR	86.28%	1'109'560.80	0.15	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	60	854	260	654 EUR	78.11%	510'839.40	0.07	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	0	710	230	480 EUR	97.88%	469'824.00	0.06	a)
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	0	2'234	620	1'614 EUR	100.14%	1'616'259.60	0.22	a)
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	0	406	120	286 EUR	100.46%	287'315.60	0.04	a)
AT0000A335K7	3.1500 % RAGB 3.15 10/20/53	0	561	110	451 EUR	100.29%	452'307.90	0.06	a)
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	0	600	0	600 EUR	103.88%	623'256.00	0.09	a)
AT0000A39UW5	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/34	0	470	0	470 EUR	99.91%	469'558.20	0.06	a)
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	427	2'603	875	2'155 EUR	110.47%	2'380'585.40	0.33	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	421	2'776	1'040	2'157 EUR	118.60%	2'558'137.29	0.35	a)
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	361	2'373	900	1'834 EUR	112.94%	2'071'319.60	0.29	a)
BE0000324336	4.5000 % BGB 4 1/2 03/28/26 64	226	1'644	610	1'260 EUR	102.98%	1'297'548.00	0.18	a)
BE0000326356	4.0000 % BGB 4 03/28/32 66	200	1'177	430	947 EUR	108.46%	1'027'116.20	0.14	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	181	1'299	440	1'040 EUR	106.30%	1'105'520.00	0.15	a)
BE0000332412	2.6000 % BGB 2.6 06/22/24 72	306	570	876	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	215	1'123	360	978 EUR	100.41%	982'009.80	0.14	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	444	2'886	1'000	2'330 EUR	96.83%	2'256'139.00	0.31	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	368	2'261	800	1'829 EUR	88.32%	1'615'372.80	0.22	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	204	1'127	380	951 EUR	85.54%	813'485.40	0.11	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	348	2'154	750	1'752 EUR	95.75%	1'677'540.00	0.23	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	213	1'385	430	1'168 EUR	71.91%	839'908.80	0.12	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	137	1'182	370	949 EUR	74.86%	710'421.40	0.10	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	279	2'188	670	1'797 EUR	93.79%	1'685'406.30	0.23	a)
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	306	450	756	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	147	930	335	742 EUR	77.53%	575'272.60	0.08	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	143	848	270	721 EUR	81.99%	591'147.90	0.08	a)
BE0000345547	0.8000 % BGB 0.8 06/22/28 85	319	2'241	790	1'770 EUR	92.32%	1'634'046.30	0.23	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	248	1'442	460	1'230 EUR	87.35%	1'074'405.00	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 EUR	in % 7)	Kat.
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	350	2'606	910	2'046 EUR	91.16%	1'865'133.60	0.26	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	145	1'537	515	1'167 EUR	71.11%	829'807.02	0.11	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	202	1'920	610	1'512 EUR	84.87%	1'283'234.40	0.18	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	193	1'060	340	913 EUR	64.35%	587'515.50	0.08	a)
BE0000351602	0.0000 % BGB 0 10/22/27 91	190	1'466	470	1'186 EUR	90.55%	1'073'923.00	0.15	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	334	1'687	550	1'471 EUR	81.00%	1'191'510.00	0.16	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/2071 93	131	836	270	697 EUR	41.78%	291'206.60	0.04	a)
BE0000354630	0.3500 % BGB 0.35 06/22/32 94	100	2'479	790	1'789 EUR	81.78%	1'463'044.20	0.20	a)
BE0000355645	1.4000 % BGB 1.4 06/22/53 95	259	1'276	410	1'125 EUR	63.60%	715'500.00	0.10	a)
BE0000356650	2.7500 % BGB 2 3/4 04/22/39 96	0	784	210	574 EUR	94.82%	544'266.80	0.08	a)
BE0000357666	3.0000 % BGB 3 06/22/33 97	0	2'425	520	1'905 EUR	100.85%	1'921'192.50	0.26	a)
BE0000358672	3.3000 % BGB 3.3 06/22/54 98	0	1'590	425	1'165 EUR	97.74%	1'138'671.00	0.16	a)
BE0000359688	3.4500 % BGB 3.45 06/22/43 99	0	650	220	430 EUR	101.73%	437'439.00	0.06	a)
BE0000360694	2.8500 % BGB 2.85 10/22/34 100	0	650	0	650 EUR	98.82%	642'330.00	0.09	a)
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	204	1'162	370	996 EUR	86.15%	858'044.04	0.12	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	119	1'079	430	768 EUR	95.43%	732'894.72	0.10	a)
DE0001030724	0.0000 % DBR 0 08/15/50 G	201	1'251	410	1'042 EUR	52.08%	542'694.44	0.07	a)
DE0001030732	0.0000 % DBR 0 08/15/31 G	154	1'235	500	889 EUR	84.23%	748'813.59	0.10	a)
DE0001030740	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 G	100	980	250	830 EUR	95.89%	795'853.80	0.11	a)
DE0001030757	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53 G	0	965	260	705 EUR	85.00%	599'242.95	0.08	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	484	0	484	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	579	4'182	1'425	3'336 EUR	98.89%	3'298'970.40	0.45	a)
DE0001102358	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/24	484	870	1'354	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	484	870	1'354	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	603	3'771	1'210	3'164 EUR	97.28%	3'077'875.92	0.42	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	603	4'333	1'760	3'176 EUR	97.00%	3'080'624.72	0.42	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	674	4'241	1'330	3'585 EUR	95.53%	3'424'750.50	0.47	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	570	4'667	1'835	3'402 EUR	93.60%	3'184'306.02	0.44	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	674	3'936	1'420	3'190 EUR	93.33%	2'977'322.70	0.41	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	610	4'365	1'540	3'435 EUR	93.36%	3'207'053.40	0.44	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	652	5'152	1'850	3'954 EUR	76.66%	3'031'255.02	0.42	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	555	3'719	1'380	2'894 EUR	92.65%	2'681'377.82	0.37	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	525	3'642	1'130	3'037 EUR	90.90%	2'760'724.11	0.38	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	579	3'876	1'420	3'035 EUR	90.10%	2'734'443.95	0.38	a)
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	609	3'968	1'420	3'157 EUR	88.01%	2'778'349.42	0.38	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	764	4'997	1'590	4'171 EUR	51.95%	2'166'625.95	0.30	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	543	3'633	1'310	2'866 EUR	87.06%	2'495'139.60	0.34	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	664	4'512	1'620	3'556 EUR	86.10%	3'061'751.56	0.42	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	484	2'950	950	2'484 EUR	76.22%	1'893'279.96	0.26	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	472	2'875	860	2'487 EUR	91.21%	2'268'467.31	0.31	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	543	3'666	1'180	3'029 EUR	85.16%	2'579'617.56	0.36	a)
DE0001102549	0.0000 % DBR 0 05/15/36	508	3'345	1'180	2'673 EUR	74.17%	1'982'483.91	0.27	a)
DE0001102556	0.0000 % DBR 0 11/15/28	570	3'375	1'070	2'875 EUR	89.39%	2'569'933.75	0.35	a)
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	640	4'175	1'460	3'355 EUR	84.23%	2'825'748.75	0.39	a)
DE0001102572	0.0000 % DBR 0 08/15/52	364	3'799	990	3'173 EUR	49.55%	1'572'348.42	0.22	a)
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	625	3'975	1'310	3'290 EUR	83.21%	2'737'477.40	0.38	a)
DE0001102598	1.0000 % DBR 1 05/15/38	150	2'920	780	2'290 EUR	81.74%	1'871'800.20	0.26	a)
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	490	3'778	1'280	2'988 EUR	95.04%	2'839'645.80	0.39	a)
DE0001102614	1.8000 % DBR 1.8 08/15/53	100	3'771	1'045	2'826 EUR	84.87%	2'398'482.72	0.33	a)
DE0001102622	2.1000 % DBR 2.1 11/15/29	174	3'815	1'280	2'709 EUR	98.40%	2'665'628.91	0.37	a)
DE0001104875	0.0000 % BKO 0 03/15/24	425	0	425	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104883	0.2000 % BKO 0.2 06/14/24	0	1'020	1'020	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104891	0.4000 % BKO 0.4 09/13/24	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001104909	2.2000 % BKO 2.2 12/12/24	0	2'240	2'240	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27	276	1'716	540	1'452 EUR	112.14%	1'628'258.28	0.22	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28	354	2'104	730	1'728 EUR	111.07%	1'919'220.48	0.26	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	276	1'954	755	1'475 EUR	109.06%	1'608'605.50	0.22	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30	229	1'449	450	1'228 EUR	120.51%	1'479'850.52	0.20	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31	435	2'775	1'060	2'150 EUR	119.35%	2'566'025.00	0.35	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	502	3'263	1'080	2'685 EUR	121.06%	3'250'407.30	0.45	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	563	3'733	1'270	3'026 EUR	116.28%	3'518'481.50	0.48	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 EUR	in % 7)	Kat.
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	389	2'525	860	2'054 EUR	121.16%	2'488'605.86	0.34	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40	417	2'807	973	2'251 EUR	128.79%	2'899'302.15	0.40	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	413	2'567	950	2'030 EUR	109.59%	2'224'595.80	0.31	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	587	4'106	1'495	3'198 EUR	98.70%	3'156'362.04	0.43	a)
DE0001141794	0.0000 % OBL 0 04/05/24 179	508	870	1'378	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141802	0.0000 % OBL 0 10/18/24 180	484	1'368	1'852	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	475	3'242	1'210	2'507 EUR	96.47%	2'418'427.69	0.33	a)
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	543	3'880	1'130	3'293 EUR	95.36%	3'140'204.80	0.43	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	543	3'820	1'365	2'998 EUR	94.29%	2'826'724.26	0.39	a)
DE0001141844	0.0000 % OBL 0 10/09/26 184	520	3'115	1'080	2'555 EUR	93.29%	2'383'585.05	0.33	a)
DE0001141851	0.0000 % OBL 0 04/16/27 185	400	3'020	1'050	2'370 EUR	92.29%	2'187'154.50	0.30	a)
DE0001141869	1.3000 % OBL 1.3 10/15/27 186	571	4'050	1'430	3'191 EUR	95.81%	3'057'265.19	0.42	a)
DE000BU22007	2.5000 % BKO 2 1/2 03/13/25	0	2'490	700	1'790 EUR	99.10%	1'773'925.80	0.24	a)
DE000BU22015	2.8000 % BKO 2.8 06/12/25	0	2'650	740	1'910 EUR	99.42%	1'898'826.50	0.26	a)
DE000BU22023	3.1000 % BKO 3.1 09/18/25 2Y	0	1'550	140	1'410 EUR	99.96%	1'409'365.50	0.19	a)
DE000BU22031	3.1000 % BKO 3.1 12/12/25 2Y	0	1'500	0	1'500 EUR	100.13%	1'501'980.00	0.21	a)
DE000BU25000	2.2000 % OBL 2.2 04/13/28 187	0	3'615	1'020	2'595 EUR	98.84%	2'564'846.10	0.35	a)
DE000BU25018	2.4000 % OBL 2.4 10/19/28 188	0	3'625	640	2'985 EUR	99.69%	2'975'806.20	0.41	a)
DE000BU25026	2.1000 % OBL 2.1 04/12/29 189	0	550	130	420 EUR	98.41%	413'313.60	0.06	a)
DE000BU27006	2.4000 % DBR 2.4 11/15/30	0	1'460	100	1'360 EUR	100.07%	1'360'992.80	0.19	a)
DE000BU22007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	0	5'842	1'810	4'032 EUR	99.43%	4'008'816.00	0.55	a)
DE000BU22015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	0	3'375	150	3'225 EUR	101.72%	3'280'470.00	0.45	a)
DE000BU22023	2.2000 % DBR 2.2 02/15/34	0	350	0	350 EUR	98.14%	343'504.00	0.05	a)
DE000BU32005	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33 G	0	1'090	435	655 EUR	99.43%	651'253.40	0.09	a)
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	476	3'682	1'390	2'768 EUR	113.86%	3'151'672.48	0.43	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	408	2'655	820	2'243 EUR	115.24%	2'584'765.91	0.36	a)
ES00000121G2	4.8000 % SPGB 4.8 01/31/24	337	0	337	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	460	2'661	850	2'271 EUR	113.34%	2'573'996.82	0.35	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	494	3'086	1'060	2'520 EUR	101.84%	2'566'342.80	0.35	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	482	3'148	980	2'650 EUR	106.44%	2'820'660.00	0.39	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	544	3'146	1'090	2'600 EUR	119.39%	3'104'036.00	0.43	a)
ES00000124C5	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/28	396	2'691	905	2'182 EUR	109.48%	2'388'744.50	0.33	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	310	2'038	650	1'698 EUR	120.36%	2'043'746.76	0.28	a)
ES00000124W3	3.8000 % SPGB 3.8 04/30/24	428	850	1'278	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	496	2'970	3'466	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES00000126Z1	1.6000 % SPGB 1.6 04/30/25	447	2'571	850	2'168 EUR	98.00%	2'124'553.28	0.29	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	496	3'210	1'215	2'491 EUR	93.95%	2'340'269.59	0.32	a)
ES00000127G9	2.1500 % SPGB 2.15 10/31/25	541	3'324	1'080	2'785 EUR	98.42%	2'740'885.60	0.38	a)
ES00000127Z9	1.9500 % SPGB 1.95 04/30/26	461	2'879	910	2'430 EUR	97.68%	2'373'526.80	0.33	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	390	2'620	915	2'095 EUR	87.22%	1'827'342.80	0.25	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	304	1'871	590	1'585 EUR	90.37%	1'432'364.50	0.20	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	547	3'712	1'310	2'949 EUR	95.69%	2'821'809.63	0.39	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	479	3'405	1'085	2'799 EUR	95.60%	2'675'760.03	0.37	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	381	2'644	810	2'215 EUR	93.13%	2'062'851.65	0.28	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	459	2'918	1'000	2'377 EUR	107.77%	2'561'692.90	0.35	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	517	3'290	1'215	2'592 EUR	94.86%	2'458'693.44	0.34	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	480	3'669	1'180	2'969 EUR	94.03%	2'791'839.77	0.38	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	291	2'639	955	1'975 EUR	82.99%	1'639'111.75	0.23	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	481	3'182	1'020	2'643 EUR	93.73%	2'477'178.18	0.34	a)
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	456	2'581	840	2'197 EUR	92.97%	2'042'463.02	0.28	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	393	2'918	970	2'341 EUR	85.84%	2'009'397.35	0.28	a)
ES0000012E85	0.2500 % SPGB 0 1/4 07/30/24 5YR	370	690	1'060	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	320	3'406	930	2'796 EUR	87.81%	2'455'083.72	0.34	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	450	3'410	1'130	2'730 EUR	86.18%	2'352'577.50	0.32	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	458	2'641	1'850	1'249 EUR	96.86%	1'209'793.89	0.17	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	414	2'940	950	2'404 EUR	53.97%	1'297'510.92	0.18	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	441	2'959	920	2'480 EUR	93.06%	2'307'937.60	0.32	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	497	3'361	1'190	2'668 EUR	89.41%	2'385'352.08	0.33	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	368	2'621	1'060	1'929 EUR	69.62%	1'342'931.22	0.19	a)
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	431	2'902	1'130	2'203 EUR	94.28%	2'076'922.31	0.29	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	413	740	1'153	0 EUR	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 EUR	in % 7)	Kat.
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	472	3'222	1'050	2'644 EUR	81.31%	2'149'836.40	0.30	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/2071	119	1'134	410	843 EUR	48.46%	408'509.37	0.06	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	400	3'684	1'070	3'014 EUR	89.25%	2'690'085.42	0.37	a)
ES0000012I24	0.8500 % SPGB 0.85 07/30/37	222	2'312	750	1'784 EUR	71.79%	1'280'680.08	0.18	a)
ES0000012I32	0.5000 % SPGB 0 1/2 10/31/31	467	3'021	1'030	2'458 EUR	82.60%	2'030'258.84	0.28	a)
ES0000012J07	1.0000 % SPGB 1 07/30/42	119	1'584	450	1'253 EUR	64.67%	810'352.69	0.11	a)
ES0000012J15	0.0000 % SPGB 0 01/31/27	292	3'028	910	2'410 EUR	91.73%	2'210'789.40	0.30	a)
ES0000012K20	0.7000 % SPGB 0.7 04/30/32	392	3'252	980	2'664 EUR	82.81%	2'206'005.12	0.30	a)
ES0000012K38	0.0000 % SPGB 0 05/31/25	150	3'113	1'130	2'133 EUR	95.96%	2'046'762.81	0.28	a)
ES0000012K46	1.9000 % SPGB 1.9 10/31/52	150	2'468	630	1'988 EUR	66.86%	1'329'137.04	0.18	a)
ES0000012K53	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/29	75	3'994	1'040	3'029 EUR	89.26%	2'703'806.56	0.37	a)
ES0000012K61	2.5500 % SPGB 2.55 10/31/32	350	3'034	920	2'464 EUR	95.49%	2'352'922.88	0.32	a)
ES0000012K95	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/43	100	1'671	510	1'261 EUR	95.92%	1'209'563.81	0.17	a)
ES0000012L29	2.8000 % SPGB 2.8 05/31/26	0	3'396	830	2'566 EUR	99.39%	2'550'296.08	0.35	a)
ES0000012L52	3.1500 % SPGB 3.15 04/30/33	0	3'724	1'130	2'594 EUR	99.59%	2'583'390.54	0.36	a)
ES0000012L60	3.9000 % SPGB 3.9 07/30/39	0	1'560	400	1'160 EUR	103.11%	1'196'087.60	0.16	a)
ES0000012L78	3.5500 % SPGB 3.55 10/31/33	0	3'416	760	2'656 EUR	102.51%	2'722'692.16	0.38	a)
ES0000012M51	3.5000 % SPGB 3 1/2 05/31/29	0	710	0	710 EUR	102.54%	728'034.00	0.10	a)
ES0000012M77	2.5000 % SPGB 2 1/2 05/31/27	0	400	0	400 EUR	98.48%	393'924.00	0.05	a)
ES0000012M85	3.2500 % SPGB 3 1/4 04/30/34	0	1'200	0	1'200 EUR	99.66%	1'195'908.00	0.16	a)
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25	95	730	250	575 EUR	100.94%	580'376.25	0.08	a)
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	126	771	210	687 EUR	99.92%	686'443.53	0.09	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	131	762	290	603 EUR	93.51%	563'883.39	0.08	a)
FI4000079041	2.0000 % RFGB 2 04/15/24	119	185	304	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	57	592	190	459 EUR	86.99%	399'288.69	0.06	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	117	572	205	484 EUR	96.64%	467'747.28	0.06	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	159	948	280	827 EUR	95.03%	785'898.10	0.11	a)
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	101	788	270	619 EUR	72.59%	449'307.34	0.06	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	160	752	275	637 EUR	92.35%	588'256.76	0.08	a)
FI4000306758	1.1250 % RFGB 1 1/8 04/15/34	109	502	170	441 EUR	84.58%	372'988.98	0.05	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	120	982	240	862 EUR	90.51%	780'222.06	0.11	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29	149	731	245	635 EUR	88.49%	561'917.85	0.08	a)
FI4000391529	0.0000 % RFGB 0 09/15/24	96	140	236	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36	95	605	160	540 EUR	70.91%	382'903.20	0.05	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	95	503	150	448 EUR	63.60%	284'928.00	0.04	a)
FI4000441878	0.0000 % RFGB 0 09/15/30	130	815	320	625 EUR	83.66%	522'881.25	0.07	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	84	578	170	492 EUR	46.41%	228'347.04	0.03	a)
FI4000507231	0.1250 % RFGB 0 1/8 09/15/31	128	871	250	749 EUR	82.02%	614'292.35	0.08	a)
FI4000511449	0.0000 % RFGB 0 09/15/26	0	542	160	382 EUR	92.96%	355'088.10	0.05	a)
FI4000517677	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/43	45	586	180	451 EUR	62.83%	283'376.83	0.04	a)
FI4000523238	1.5000 % RFGB 1 1/2 09/15/32	105	808	265	648 EUR	89.97%	583'005.60	0.08	a)
FI4000527551	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/27	0	575	170	405 EUR	95.67%	387'443.25	0.05	a)
FI4000546528	2.7500 % RFGB 2 3/4 04/15/38	0	521	100	421 EUR	96.17%	404'879.91	0.06	a)
FI4000550249	3.0000 % RFGB 3 09/15/33	0	895	245	650 EUR	101.03%	656'701.50	0.09	a)
FI4000557525	2.8750 % RFGB 2 7/8 04/15/29	0	280	0	280 EUR	100.45%	281'262.80	0.04	a)
FI4000566294	2.9500 % RFGB 2.95 04/15/55	0	315	0	315 EUR	97.78%	308'003.85	0.04	a)
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	720	4'564	1'600	3'684 EUR	121.95%	4'492'638.00	0.62	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	678	3'803	1'320	3'161 EUR	104.50%	3'303'245.00	0.46	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	756	5'070	1'580	4'246 EUR	112.99%	4'797'555.40	0.66	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	589	3'659	1'160	3'088 EUR	116.70%	3'603'696.00	0.50	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	428	2'698	1'020	2'106 EUR	112.73%	2'374'093.80	0.33	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	490	3'722	1'435	2'777 EUR	110.40%	3'065'779.30	0.42	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	693	5'109	1'830	3'972 EUR	117.38%	4'662'333.60	0.64	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	346	2'577	860	2'063 EUR	114.19%	2'355'739.70	0.32	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	919	5'780	2'080	4'619 EUR	101.12%	4'670'732.80	0.64	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	1'104	7'400	2'420	6'084 EUR	99.90%	6'077'916.00	0.84	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	607	4'177	1'590	3'194 EUR	100.04%	3'195'277.60	0.44	a)
FR0011619436	2.2500 % FRTR 2 1/4 05/25/24	831	1'440	2'271	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	1'042	8'817	3'330	6'529 EUR	98.78%	6'449'346.20	0.89	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	845	4'567	5'412	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	899	6'128	2'650	4'377 EUR	96.66%	4'230'808.20	0.58	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 EUR	in % 7)	Kat.
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	750	5'035	1'820	3'965 EUR	96.53%	3'827'414.50	0.53	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	1'205	7'912	2'645	6'472 EUR	92.01%	5'954'887.20	0.82	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	977	6'815	2'470	5'322 EUR	94.85%	5'047'917.00	0.70	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	284	2'209	700	1'793 EUR	67.39%	1'208'302.70	0.17	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	883	6'269	2'225	4'927 EUR	82.05%	4'042'603.50	0.56	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	713	5'019	1'570	4'162 EUR	93.28%	3'882'313.60	0.54	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	585	4'339	1'430	3'494 EUR	83.70%	2'924'478.00	0.40	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	841	5'405	1'880	4'366 EUR	94.53%	4'127'179.80	0.57	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	623	3'885	1'320	3'188 EUR	78.97%	2'517'563.60	0.35	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	1'149	8'160	2'685	6'624 EUR	92.19%	6'106'665.60	0.84	a)
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	810	6'116	2'080	4'846 EUR	85.46%	4'141'391.60	0.57	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	1'104	8'041	2'950	6'195 EUR	91.36%	5'659'752.00	0.78	a)
FR0013344751	0.0000 % FRTR 0 03/25/24	880	0	880	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	608	4'610	1'750	3'468 EUR	68.97%	2'391'879.60	0.33	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	1'065	7'650	2'680	6'035 EUR	89.33%	5'391'065.50	0.74	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	1'045	5'920	2'030	4'935 EUR	96.48%	4'761'288.00	0.66	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	884	6'267	2'185	4'966 EUR	85.82%	4'261'821.20	0.59	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	650	4'357	1'420	3'587 EUR	54.06%	1'939'132.20	0.27	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	908	5'825	1'950	4'783 EUR	94.34%	4'512'282.20	0.62	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	480	3'330	1'040	2'770 EUR	66.52%	1'842'604.00	0.25	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	1'075	7'590	2'660	6'005 EUR	83.44%	5'010'572.00	0.69	a)
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/2072	203	1'740	560	1'383 EUR	38.61%	533'976.30	0.07	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	297	2'796	740	2'353 EUR	59.94%	1'410'388.20	0.19	a)
FR0014002VK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	960	7'082	2'385	5'657 EUR	81.01%	4'582'735.70	0.63	a)
FR0014003513	0.0000 % FRTR 0 02/25/27	622	6'134	2'390	4'366 EUR	92.04%	4'018'466.40	0.55	a)
FR0014004J31	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/53	454	4'236	1'410	3'280 EUR	52.90%	1'735'120.00	0.24	a)
FR0014007L00	0.0000 % FRTR 0 05/25/32	716	4'750	1'520	3'946 EUR	79.77%	3'147'724.20	0.43	a)
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	233	4'280	2'260	2'253 EUR	96.68%	2'178'200.40	0.30	a)
FR0014009O62	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/38	75	2'226	390	1'911 EUR	78.68%	1'503'574.80	0.21	a)
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	400	7'041	2'150	5'291 EUR	92.56%	4'897'349.60	0.67	a)
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	537	6'415	2'060	4'892 EUR	93.75%	4'586'250.00	0.63	a)
FR001400CMX2	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/43	100	1'990	670	1'420 EUR	89.34%	1'268'628.00	0.17	a)
FR001400FTH3	3.0000 % FRTR 3 05/25/54	0	3'180	640	2'540 EUR	93.64%	2'378'456.00	0.33	a)
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	0	6'410	1'440	4'970 EUR	99.05%	4'922'785.00	0.68	a)
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	0	5'071	1'005	4'066 EUR	101.20%	4'114'616.92	0.57	a)
FR001400HI98	2.7500 % FRTR 2 3/4 02/25/29	0	4'626	695	3'931 EUR	100.05%	3'932'965.50	0.54	a)
FR001400L834	3.5000 % FRTR 3 1/2 11/25/33	0	2'210	125	2'085 EUR	105.12%	2'191'752.00	0.30	a)
FR001400NBC6	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/27	0	500	0	500 EUR	99.00%	495'000.00	0.07	a)
FR001400NEF3	3.0000 % FRTR 3 06/25/49	0	825	0	825 EUR	95.41%	787'132.50	0.11	a)
IE000GLVBXU6	3.0000 % IRISH 3 10/18/43	0	588	140	448 EUR	100.13%	448'582.40	0.06	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	223	1'533	460	1'296 EUR	101.88%	1'320'364.80	0.18	a)
IE00B6X95T99	3.4000 % IRISH 3.4 03/18/24	91	0	91	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IE00BDHDP44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	201	965	330	836 EUR	93.14%	778'650.40	0.11	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	121	619	190	550 EUR	88.41%	486'255.00	0.07	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	163	834	270	727 EUR	91.73%	666'877.10	0.09	a)
IE00BH3SQ895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	193	1'356	480	1'069 EUR	92.49%	988'718.10	0.14	a)
IE00BH3SQB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	169	1'179	380	968 EUR	72.13%	698'218.40	0.10	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	223	1'179	370	1'032 EUR	98.54%	1'016'932.80	0.14	a)
IE00BKFVC345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	127	617	210	534 EUR	76.88%	410'539.20	0.06	a)
IE00BKFVC568	0.2000 % IRISH 0.2 05/15/27	172	944	290	826 EUR	92.35%	762'811.00	0.11	a)
IE00BKFVC899	0.2000 % IRISH 0.2 10/18/30	142	1'103	320	925 EUR	85.26%	788'655.00	0.11	a)
IE00BMD03L28	0.3500 % IRISH 0.35 10/18/32	0	774	220	554 EUR	82.09%	454'778.60	0.06	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	218	1'171	420	969 EUR	81.81%	792'738.90	0.11	a)
IE00BMQ5JM72	0.5500 % IRISH 0.55 04/22/41	98	478	160	416 EUR	67.51%	280'841.60	0.04	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	230	1'410	490	1'150 EUR	83.90%	964'850.00	0.13	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	216	1'457	510	1'163 EUR	96.06%	1'117'177.80	0.15	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	121	984	300	805 EUR	86.51%	696'405.50	0.10	a)
IT0001086567	7.2500 % BTPS 7 1/4 11/01/26 30Y	245	1'576	480	1'341 EUR	110.16%	1'477'191.96	0.20	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27 30Y	585	3'592	1'260	2'917 EUR	111.22%	3'244'345.74	0.45	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29 31Y	612	4'129	1'440	3'301 EUR	109.70%	3'621'064.96	0.50	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31 31Y	591	4'252	1'380	3'463 EUR	115.83%	4'011'331.42	0.55	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 EUR	in % 7)	Kat.
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33 31Y	468	3'657	1'200	2'925 EUR	115.37%	3'374'484.75	0.47	a)
IT0003535157	5.0000 % BTPS 5 08/01/34 31Y	547	3'403	1'120	2'830 EUR	109.84%	3'108'443.70	0.43	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37 31Y	543	4'263	1'370	3'436 EUR	100.27%	3'445'277.20	0.47	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39 32Y	491	3'462	1'250	2'703 EUR	109.36%	2'956'054.86	0.41	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25 16Y	537	3'145	1'030	2'652 EUR	101.36%	2'688'146.76	0.37	a)
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40 31Y	476	2'908	970	2'414 EUR	109.37%	2'640'264.22	0.36	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26 16Y	484	2'897	940	2'441 EUR	102.24%	2'495'605.17	0.34	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28 15Y	518	3'031	990	2'559 EUR	106.03%	2'713'307.70	0.37	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44 31Y	378	2'465	770	2'073 EUR	106.56%	2'208'926.61	0.30	a)
IT0004953417	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/24 11Y	503	0	503	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005001547	3.7500 % BTPS 3 3/4 09/01/24 10Y	421	825	1'246	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005024234	3.5000 % BTPS 3 1/2 03/01/30 16Y	571	3'802	1'230	3'143 EUR	100.53%	3'159'500.75	0.44	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24 10Y	434	2'723	3'157	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005083057	3.2500 % BTPS 3 1/4 09/01/46 31Y	315	2'326	770	1'871 EUR	86.08%	1'610'575.51	0.22	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25 10Y	420	2'674	850	2'244 EUR	97.63%	2'190'862.08	0.30	a)
IT0005094088	1.6500 % BTPS 1.65 03/01/32 17Y	517	3'356	1'120	2'753 EUR	86.64%	2'385'281.79	0.33	a)
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25 10Y	435	2'498	810	2'123 EUR	97.79%	2'075'996.78	0.29	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47 31Y	411	2'379	830	1'960 EUR	78.19%	1'532'582.80	0.21	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26 10Y	465	3'012	1'050	2'427 EUR	96.41%	2'339'870.70	0.32	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36 20Y	335	2'193	670	1'858 EUR	83.07%	1'543'496.34	0.21	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26 10Y	435	2'652	910	2'177 EUR	94.88%	2'065'537.60	0.28	a)
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67 50Y	189	1'279	430	1'038 EUR	72.46%	752'176.32	0.10	a)
IT0005240350	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/33 15Y	397	2'616	940	2'073 EUR	89.94%	1'864'435.47	0.26	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27 10Y	361	2'517	730	2'148 EUR	96.90%	2'081'326.08	0.29	a)
IT0005246340	1.8500 % BTPS 1.85 05/15/24 7Y	301	560	861	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48 31Y	339	2'368	770	1'937 EUR	88.50%	1'714'148.15	0.24	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27 10Y	406	2'463	900	1'969 EUR	96.25%	1'895'103.43	0.26	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24 7Y	379	2'010	2'389	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38 20Y	306	1'867	580	1'593 EUR	87.63%	1'395'977.76	0.19	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28 10Y	498	3'066	960	2'604 EUR	95.50%	2'486'846.04	0.34	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25 7Y	367	2'216	750	1'833 EUR	97.68%	1'790'437.74	0.25	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28 10Y	457	3'040	1'190	2'307 EUR	97.94%	2'259'452.73	0.31	a)
IT0005345183	2.5000 % BTPS 2 1/2 11/15/25 7Y	413	2'405	830	1'988 EUR	98.66%	1'961'261.40	0.27	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35 26Y	327	1'874	580	1'621 EUR	95.09%	1'541'392.69	0.21	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49 30Y	317	2'086	720	1'683 EUR	93.76%	1'578'048.12	0.22	a)
IT0005365165	3.0000 % BTPS 3 08/01/29 10Y	467	2'837	910	2'394 EUR	98.22%	2'351'386.80	0.32	a)
IT0005367492	1.7500 % BTPS 1 3/4 07/01/24 5Y	315	725	1'040	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26 7Y	349	2'265	710	1'904 EUR	97.41%	1'854'762.56	0.26	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40 21Y	267	1'974	620	1'621 EUR	87.65%	1'420'838.92	0.20	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30 11Y	515	3'037	1'090	2'462 EUR	88.70%	2'183'670.90	0.30	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25 6Y	436	2'426	1'450	1'412 EUR	97.13%	1'371'489.72	0.19	a)
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27 8Y	405	2'594	850	2'149 EUR	93.56%	2'010'561.42	0.28	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	336	2'186	755	1'767 EUR	72.24%	1'276'533.81	0.18	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36 16Y	342	1'772	710	1'404 EUR	76.28%	1'071'027.36	0.15	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30 10Y	399	2'583	820	2'162 EUR	85.65%	1'851'817.86	0.26	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25 5Y	391	2'139	690	1'840 EUR	97.97%	1'802'592.80	0.25	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30 10Y	499	3'021	1'060	2'460 EUR	88.95%	2'188'219.20	0.30	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27 7Y	462	2'700	860	2'302 EUR	92.46%	2'128'452.22	0.29	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26 5Y	391	2'630	995	2'026 EUR	94.82%	1'921'073.46	0.26	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41 21Y	345	2'054	650	1'749 EUR	71.35%	1'247'824.05	0.17	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31 11Y	483	3'126	970	2'639 EUR	83.76%	2'210'294.45	0.30	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51 31Y	324	2'116	720	1'720 EUR	60.73%	1'044'487.20	0.14	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37 16Y	350	2'165	670	1'845 EUR	69.43%	1'280'928.15	0.18	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28 7Y	416	2'595	1'010	2'001 EUR	88.76%	1'776'027.57	0.24	a)
IT0005436693	0.6000 % BTPS 0.6 08/01/31 10Y	432	2'746	915	2'263 EUR	81.03%	1'833'663.64	0.25	a)
IT0005437147	0.0000 % BTPS 0 04/01/26 5Y	420	3'420	1'880	1'960 EUR	93.45%	1'831'541.60	0.25	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45 34Y	271	1'782	640	1'413 EUR	62.88%	888'522.66	0.12	a)
IT0005439275	0.0000 % BTPS 0 04/15/24 3Y	385	750	1'135	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005441883	2.1500 % BTPS 2.15 03/01/2072 50Y	69	890	230	729 EUR	60.08%	437'961.33	0.06	a)
IT0005445306	0.5000 % BTPS 0 1/2 07/15/28 7Y	300	2'108	720	1'688 EUR	88.88%	1'500'260.64	0.21	a)
IT0005449969	0.9500 % BTPS 0.95 12/01/31 10Y	419	2'610	810	2'219 EUR	82.45%	1'829'632.07	0.25	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 EUR	in % 7)	Kat.
IT0005452989	0.0000 % BTPS 0 08/15/24 3Y	329	545	874	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005454241	0.0000 % BTPS 0 08/01/26 5Y	417	2'448	870	1'995 EUR	92.51%	1'845'634.35	0.25 a)	
IT0005466013	0.9500 % BTPS 0.95 06/01/32 10Y	438	2'694	880	2'252 EUR	81.22%	1'829'074.40	0.25 a)	
IT0005467482	0.4500 % BTPS 0.45 02/15/29 7Y	335	2'509	1'080	1'764 EUR	87.02%	1'535'015.16	0.21 a)	
IT0005474330	0.0000 % BTPS 0 12/15/24 3Y	250	2'070	2'320	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005480980	2.1500 % BTPS 2.15 09/01/52 30Y	150	1'165	360	955 EUR	66.13%	631'579.70	0.09 a)	
IT0005484552	1.1000 % BTPS 1.1 04/01/27 5Y	225	1'843	550	1'518 EUR	93.81%	1'423'990.26	0.20 a)	
IT0005493298	1.2000 % BTPS 1.2 08/15/25 3Y	0	2'410	690	1'720 EUR	96.88%	1'666'301.60	0.23 a)	
IT0005494239	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/32 10Y	300	2'410	650	2'060 EUR	91.42%	1'883'231.40	0.26 a)	
IT0005495731	2.8000 % BTPS 2.8 06/15/29 7Y	100	2'457	670	1'887 EUR	97.27%	1'835'390.55	0.25 a)	
IT0005496770	3.2500 % BTPS 3 1/4 03/01/38 16Y	0	1'700	400	1'300 EUR	91.11%	1'184'430.00	0.16 a)	
IT0005499311	1.7500 % BTPS 1 3/4 05/30/24 2Y	0	1'000	1'000	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
IT0005500068	2.6500 % BTPS 2.65 12/01/27 5Y	150	2'535	860	1'825 EUR	97.95%	1'787'624.00	0.25 a)	
IT0005508590	4.0000 % BTPS 4 04/30/35 13Y	0	1'888	600	1'288 EUR	101.13%	1'302'515.76	0.18 a)	
IT0005514473	3.5000 % BTPS 3 1/2 01/15/26 3Y	0	2'490	690	1'800 EUR	100.26%	1'804'698.00	0.25 a)	
IT0005518128	4.4000 % BTPS 4.4 05/01/33 10Y	150	3'079	1'030	2'199 EUR	105.34%	2'316'382.62	0.32 a)	
IT0005519787	3.8500 % BTPS 3.85 12/15/29 7Y	150	2'616	740	2'026 EUR	102.20%	2'070'592.26	0.29 a)	
IT0005521981	3.4000 % BTPS 3.4 04/01/28 5Y	0	2'670	750	1'920 EUR	100.50%	1'929'542.40	0.27 a)	
IT0005530032	4.4500 % BTPS 4.45 09/01/43 20Y	0	1'525	520	1'005 EUR	102.27%	1'027'833.60	0.14 a)	
IT0005534141	4.5000 % BTPS 4 1/2 10/01/53 30Y	0	1'825	300	1'525 EUR	102.55%	1'563'857.00	0.22 a)	
IT0005534281	3.4000 % BTPS 3.4 03/28/25 2Y	0	2'085	480	1'605 EUR	99.82%	1'602'046.80	0.22 a)	
IT0005538597	3.8000 % BTPS 3.8 04/15/26 3Y	0	2'460	640	1'820 EUR	101.01%	1'838'345.60	0.25 a)	
IT0005542359	4.0000 % BTPS 4 10/30/31 8Y	0	1'404	400	1'004 EUR	102.97%	1'033'858.96	0.14 a)	
IT0005542797	3.7000 % BTPS 3.7 06/15/30 7Y	0	2'237	630	1'607 EUR	101.25%	1'627'007.15	0.22 a)	
IT0005544082	4.3500 % BTPS 4.35 11/01/33 10Y	0	2'535	470	2'065 EUR	104.64%	2'160'712.75	0.30 a)	
IT0005548315	3.8000 % BTPS 3.8 08/01/28 5Y	0	2'215	370	1'845 EUR	102.04%	1'882'619.55	0.26 a)	
IT0005556011	3.8500 % BTPS 3.85 09/15/26 3Y	0	2'245	360	1'885 EUR	101.42%	1'911'767.00	0.26 a)	
IT0005557084	3.6000 % BTPS 3.6 09/29/25 2Y	0	1'580	275	1'305 EUR	100.26%	1'308'353.85	0.18 a)	
IT0005560948	4.2000 % BTPS 4.2 03/01/34 10Y	0	2'025	0	2'025 EUR	103.25%	2'090'880.74	0.29 a)	
IT0005561888	4.0000 % BTPS 4 11/15/30 7Y	0	1'465	0	1'465 EUR	102.89%	1'507'411.60	0.21 a)	
IT0005566408	4.1000 % BTPS 4.1 02/01/29 5Y	0	990	0	990 EUR	103.41%	1'023'759.00	0.14 a)	
IT0005580045	2.9500 % BTPS 2.95 02/15/27 3Y	0	600	0	600 EUR	99.14%	594'864.00	0.08 a)	
IT0005580094	3.5000 % BTPS 3 1/2 02/15/31 7Y	0	250	0	250 EUR	99.77%	249'422.50	0.03 a)	
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	377	2'417	820	1'974 EUR	112.79%	2'225'910.65	0.31 a)	
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	259	1'636	500	1'395 EUR	110.10%	1'535'895.00	0.21 a)	
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	397	2'507	950	1'954 EUR	112.92%	2'206'569.72	0.30 a)	
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	368	2'043	810	1'601 EUR	98.88%	1'582'574.40	0.22 a)	
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	437	2'651	920	2'168 EUR	99.51%	2'157'078.27	0.30 a)	
NL0010733424	2.0000 % NETHER 2 07/15/24	378	665	1'043	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	433	2'280	820	1'893 EUR	96.12%	1'819'551.60	0.25 a)	
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	400	2'318	750	1'968 EUR	94.71%	1'863'892.80	0.26 a)	
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	365	2'285	760	1'890 EUR	93.84%	1'773'576.00	0.24 a)	
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	297	2'769	1'045	2'021 EUR	92.28%	1'864'978.80	0.26 a)	
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	240	1'758	670	1'328 EUR	88.33%	1'173'022.40	0.16 a)	
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	254	2'145	710	1'689 EUR	70.72%	1'194'460.80	0.16 a)	
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	303	1'836	550	1'589 EUR	84.82%	1'347'789.80	0.19 a)	
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	267	1'972	660	1'579 EUR	82.61%	1'304'411.90	0.18 a)	
NL0015000B11	0.0000 % NETHER 0 01/15/38	190	1'352	410	1'132 EUR	67.89%	768'514.80	0.11 a)	
NL0015000L58	0.0000 % NETHER 0 01/15/29	192	1'645	490	1'347 EUR	88.11%	1'186'841.70	0.16 a)	
NL0015000QL2	0.0000 % NETHER 0 01/15/26	0	2'082	470	1'612 EUR	94.62%	1'525'209.92	0.21 a)	
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	228	1'722	530	1'420 EUR	84.05%	1'193'510.00	0.16 a)	
NL00150012X2	2.0000 % NETHER 2 01/15/54	60	1'240	410	890 EUR	84.88%	755'432.00	0.10 a)	
NL0015001AM2	2.5000 % NETHER 2 1/2 07/15/33	0	1'625	330	1'295 EUR	98.42%	1'274'539.00	0.18 a)	
NL0015001DQ7	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/30	0	1'245	330	915 EUR	99.21%	907'771.50	0.13 a)	
NL0015001RG8	3.2500 % NETHER 3 1/4 01/15/44	0	580	60	520 EUR	106.53%	553'950.80	0.08 a)	
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	324	2'042	730	1'636 EUR	92.55%	1'514'118.00	0.21 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 EUR	in % 7)	Kat.
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	287	2'358	750	1'895 EUR	47.83%	906'378.50	0.12	a)
EUR							716'966'166.01	98.81	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

EUR/CHF	Verfall	27.12.2023	640'000	677'504	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	28.12.2023	18'774'716	17'680'000	EUR/CHF	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

EUR/CHF	Verfall	04.04.2023	13'060'595	13'161'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.04.2023	46'000	46'045	EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.04.2023	13'115'000	13'015'588	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.05.2023	13'227'724	13'349'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.05.2023	80'386	81'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.05.2023	922'102	937'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	03.05.2023	14'367'000	14'118'882	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	02.06.2023	14'042'535	14'314'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	02.06.2023	159'826	163'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	02.06.2023	14'477'000	14'107'402	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.07.2023	14'215'601	14'615'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.07.2023	68'163	70'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.07.2023	97'000	95'013	EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.07.2023	14'588'000	14'240'601	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.08.2023	14'074'646	14'441'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.08.2023	53'684	55'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	03.08.2023	14'496'000	13'853'827	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.09.2023	13'981'092	14'657'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.09.2023	98'591	103'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.09.2023	14'760'000	14'150'515	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.10.2023	14'022'330	14'652'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.10.2023	62'010	65'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	03.10.2023	14'717'000	14'254'886	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	02.11.2023	13'591'732	14'060'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	02.11.2023	111'708	116'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	02.11.2023	14'176'000	13'635'894	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.12.2023	13'692'517	14'265'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.12.2023	31'595	33'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.12.2023	14'298'000	13'564'513	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.01.2024	14'039'457	14'830'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.01.2024	67'923	72'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.01.2024	88'476	94'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.01.2024	14'996'000	13'941'031	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	02.02.2024	14'776'616	15'925'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	02.02.2024	136'000	126'224	EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	02.02.2024	15'789'000	14'712'980	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.03.2024	14'408'614	15'494'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.03.2024	168'563	181'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.03.2024	15'675'000	14'937'491	EUR/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.04.2024	14'336'551	15'075'000	CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	03.04.2024	12'000	11'425	EUR/CHF	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert EUR	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'424'621.57	0.20
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	716'966'166.01	98.81
Sonstige Vermögenswerte	7'219'814.19	0.99
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	725'610'601.77	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-5'597.26	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	725'605'004.51	

Bewertungskategorien		Kurswert EUR	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);	716'966'166.01	98.81
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	194'275'262.32	26.77
------------------------------	-----------------------	--------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				194'275'262.32	26.77
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	174 EUR	110.68%	192'579.72	0.03
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	1'250 EUR	92.52%	1'156'500.00	0.16
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	1'500 EUR	89.55%	1'343'250.00	0.19
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	400 EUR	45.67%	182'680.00	0.03
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	298 EUR	82.39%	245'522.20	0.03
AT0000A335H3	2.9000 % RAGB 2.9 05/23/29	280 EUR	100.46%	281'288.00	0.04
AT0000A38239	3.4500 % RAGB 3.45 10/20/30	500 EUR	103.88%	519'380.00	0.07
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	768 EUR	95.43%	732'894.72	0.10
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	2'000 EUR	97.28%	1'945'560.00	0.27
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	600 EUR	97.00%	581'982.00	0.08
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	3'200 EUR	95.53%	3'056'960.00	0.42
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	3'000 EUR	93.60%	2'808'030.00	0.39
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	500 EUR	93.33%	466'665.00	0.06
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	3'000 EUR	93.36%	2'800'920.00	0.39
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	3'450 EUR	76.66%	2'644'873.50	0.36
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	2'500 EUR	92.65%	2'316'325.00	0.32
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	525 EUR	90.90%	477'240.75	0.07
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	3'000 EUR	90.10%	2'702'910.00	0.37
DE0001102473	0.0000 % DBR 0 08/15/29	3'000 EUR	88.01%	2'640'180.00	0.36
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	2'866 EUR	87.06%	2'495'139.60	0.34
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	3'000 EUR	86.10%	2'583'030.00	0.36
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	2'450 EUR	91.21%	2'234'718.50	0.31
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	2'400 EUR	85.16%	2'043'936.00	0.28
DE0001102564	0.0000 % DBR 0 08/15/31	2'500 EUR	84.23%	2'105'625.00	0.29
DE0001102580	0.0000 % DBR 0 02/15/32	3'290 EUR	83.21%	2'737'477.40	0.38
DE0001102606	1.7000 % DBR 1.7 08/15/32	2'988 EUR	95.04%	2'839'645.80	0.39
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28	1'475 EUR	109.06%	1'608'605.50	0.22
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34	2'500 EUR	121.06%	3'026'450.00	0.42
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37	3'000 EUR	116.28%	3'488'250.00	0.48
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39	1'050 EUR	121.16%	1'272'169.50	0.18
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	2'500 EUR	96.47%	2'411'675.00	0.33
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	2'600 EUR	95.36%	2'479'360.00	0.34
DE000BU22007	2.3000 % DBR 2.3 02/15/33	3'800 EUR	99.43%	3'778'150.00	0.52
DE000BU22015	2.6000 % DBR 2.6 08/15/33	3'175 EUR	101.72%	3'229'610.00	0.45
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	687 EUR	99.92%	686'443.53	0.09
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	400 EUR	96.64%	386'568.00	0.05
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	827 EUR	95.03%	785'898.10	0.11
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	800 EUR	90.51%	724'104.00	0.10
FI4000441878	0.0000 % RFGB 0 09/15/30	100 EUR	83.66%	83'661.00	0.01
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	3'680 EUR	121.95%	4'487'760.00	0.62
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	4'246 EUR	112.99%	4'797'555.40	0.66
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	2'522 EUR	116.70%	2'943'174.00	0.41
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	500 EUR	110.40%	552'000.00	0.08
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	3'972 EUR	117.38%	4'662'333.60	0.64
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	4'600 EUR	101.12%	4'651'520.00	0.64
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	6'084 EUR	99.90%	6'077'916.00	0.84
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	5'650 EUR	98.78%	5'581'070.00	0.77
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	924 EUR	96.66%	893'138.40	0.12
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	3'900 EUR	96.53%	3'764'670.00	0.52
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	6'450 EUR	92.01%	5'934'645.00	0.82
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	4'620 EUR	94.85%	4'382'070.00	0.60
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	4'927 EUR	82.05%	4'042'603.50	0.56

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert EUR	in % (7)	Kat.
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	4'000 EUR	93.28%	3'731'200.00	0.51	
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	3'100 EUR	83.70%	2'594'700.00	0.36	
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	1'244 EUR	94.53%	1'175'953.20	0.16	
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	6'600 EUR	92.19%	6'084'540.00	0.84	
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	4'846 EUR	85.46%	4'141'391.60	0.57	
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	6'195 EUR	91.36%	5'659'752.00	0.78	
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	6'030 EUR	89.33%	5'386'599.00	0.74	
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	4'900 EUR	96.48%	4'727'520.00	0.65	
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	4'966 EUR	85.82%	4'261'821.20	0.59	
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	600 EUR	54.06%	324'360.00	0.04	
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	4'780 EUR	94.34%	4'509'452.00	0.62	
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	520 EUR	66.52%	345'904.00	0.05	
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	5'965 EUR	83.44%	4'977'196.00	0.69	
FR0014002WK3	0.0000 % FRTR 0 11/25/31	5'600 EUR	81.01%	4'536'560.00	0.63	
FR0014007TY9	0.0000 % FRTR 0 02/25/25	2'250 EUR	96.68%	2'175'300.00	0.30	
FR001400AIN5	0.7500 % FRTR 0 3/4 02/25/28	5'200 EUR	92.56%	4'813'120.00	0.66	
FR001400BKZ3	2.0000 % FRTR 2 11/25/32	4'800 EUR	93.75%	4'500'000.00	0.62	
FR001400FYQ4	2.5000 % FRTR 2 1/2 09/24/26	4'970 EUR	99.05%	4'922'785.00	0.68	
FR001400H7V7	3.0000 % FRTR 3 05/25/33	4'060 EUR	101.20%	4'108'720.00	0.57	
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	283 EUR	84.82%	240'040.60	0.03	
NL0015000RP1	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/32	228 EUR	84.05%	191'634.00	0.03	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CHF 1 = EUR 1.04944637

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	EUR	22'330'547.62	10.441
Bond	EUR	190'787'586.75	89.207
Equity	EUR	751'322.04	0.351
Total	EUR	213'869'456.41	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)	EUR	15'045'441.54	2.074
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	11'990.07	0.002

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	
FA EUR	EUR	0.00 - 0.10	-	0.038	-	-	-
FAH1 CHF	EUR	0.00 - 0.10	-	0.038	-	-	-
GT EUR	EUR	0.00 - 0.10	-	0.038	-	-	-
NT EUR	EUR	0.00 - 0.10	-	0.038	-	-	-
NTH1 CHF	EUR	0.00 - 0.10	-	0.038	-	-	-

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	EUR	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	EUR	194'275'262.32
Andere Wertpapiere	EUR	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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
FA EUR	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
FAH1 CHF	0.200	0.550	0.100	0.100	3.000
GT EUR	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT EUR	-	-	-	-	3.000
NTH1 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

FTSE EMU Government Bond 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 EUR	Ja	EUR	1.35000	0.47250	0.87750
FAH1 CHF	Ja	EUR	1.75000	0.61250	1.13750

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
GT EUR	Ja	EUR	1.447	0.506	0.941
NT EUR	Ja	EUR	1.801	0.630	1.171
NTH1 CHF	Ja	EUR	1.574	0.550	1.024

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: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

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 Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich der Anteilklasse 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 (Vereinigungstichtag).

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 Anteilsklassen 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 Bankwerkstage nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die ausgeliehenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom ausleihfähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% ausleihen. Sichert hingegen der Borger oder der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerktag wieder rechtlich über die ausgeliehenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte ausleihfähige Bestand einer Art ausgeliehen werden.
5. Die Fondsleitung vereinbart mit dem Borger oder Vermittler, dass dieser zwecks Sicherstellung des Rückerstattungsanspruches zugunsten der Fondsleitung Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA verpfändet oder zu Eigentum überträgt. Der Wert der Sicherheiten muss angemessen sein und jederzeit mindestens 100% des Verkehrswerts der ausgeliehenen Effekten betragen. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

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 Anteilsklassen 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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

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

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

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

betreffend das Teilvermögen

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

hinsichtlich

Vereinigungen vom 22. November 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigungen

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

2 Umtauschverhältnis

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

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

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

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

2.2 Umtauschverhältnisse

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

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

Übertragende Teilvermögen	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	ST EUR	1 zu 825.0476743532
	NT EUR	1 zu 0.8153282314
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	ST EUR	1 zu 741.3130290303
	NT EUR	1 zu 0.9524302585
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	ST EUR	1 zu 818.2917647532

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 21. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich