

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD (EX JPY/CHF) INFLATION-LINKED

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
FAH1 CHF	31562134	CHF
NTH1 CHF	11704835	CHF
STH1 CHF	127100537	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
- ▶ Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

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

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigegeführten 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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	16
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	16
7	Pauschale Verwaltungskommission	17
8	Benchmark	17
9	TER	17
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	18
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	18
12	Fussnoten	18
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19
14	Pflichtpublikationen	21

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		290'895'155.24	250'671'180.29	211'024'747.69	219'611'734.68
Klasse FAH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'211'016.99	14'906'264.97	16'010'219.61	13'501'346.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		124'069.216	176'133.152	150'215.772	132'256.164
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.3010	84.6307	106.5815	102.0848
Ausschüttung je Anteil		0.05	0.15	2.60	1.40
Total Expense Ratio (TER)		0.25 %	0.25 %	0.25 %	0.25 %
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		227'782'158.06	235'764'915.32	195'014'528.08	206'110'387.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'128'393.204	2'148'692.096	1'439'826.113	1'605'080.596
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		107.0207	109.7248	135.4431	128.4112
Thesaurierung je Anteil		-	0.41	3.61	2.14
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse STH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		52'901'980.19			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		538.945			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98'158.4024			
Total Expense Ratio (TER)		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 FAH1 CHF	-2.58 %	-0.29 %	-19.93 %	3.95 %
Klasse NTH1 CHF	-2.34 %	-0.04 %	-19.72 %	4.21 %
Klasse STH1 CHF (Lancierung 31.05.2023)	-1.84 %	0.68 %	-	-
Benchmark Hedge	-2.36 %	-0.12 %	-19.72 %	-
Benchmark	-	-	-	4.10 %
Tracking Error 33)	0.08 %	0.09 %	0.17 %	0.10 %

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 FAH1 CHF	-0.22 %
Klasse NTH1 CHF	0.02 %
Klasse STH1 CHF (Lancierung 31.05.2023)	0.52 %

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	1'416'451.33	398'016.85
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	288'588'829.28	249'584'264.99
Sonstige Vermögenswerte	891'918.22	691'858.55
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	290'897'198.83	250'674'140.39
Andere Verbindlichkeiten	-2'043.59	-2'960.10
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	290'895'155.24	250'671'180.29

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FAH1 CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		176'133.152	150'215.772
Ausgegebene Anteile		6'262.590	42'609.793
Zurückgenommene Anteile		-58'326.526	-16'692.413
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		124'069.216	176'133.152

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'148'692.096	1'439'826.113
Ausgegebene Anteile		1'252'672.150	764'088.976
Zurückgenommene Anteile		-1'272'971.042	-55'222.993
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'128'393.204	2'148'692.096

Klasse STH1 CHF	von bis	Lancierung 31.05.2023 29.02.2024
Ausgegebene Anteile		538.945
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		538.945

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		250'671'180.29	211'024'747.69
Ausbezahlte Ausschüttung		-21'474.54	-370'463.01
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-179'576.74	-1'911'598.11
Saldo aus dem Anteilverkehr		47'268'902.66	83'542'838.65
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-6'843'876.43	-41'614'344.93
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		290'895'155.24	250'671'180.29

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		14'170.41	756.91
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-2'810.21
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		-8'546'721.72	616'048.66
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds-/anteilen		175'472.57	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-4'391'975.05	357'839.12
Total Ertrag		-12'749'053.79	971'834.48
Aufwand			
Passivzinsen		-0.44	-104.71
Reglementarische Vergütungen		-30'441.24	-34'304.03
Sonstige Aufwendungen		-84.00	-17.60
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		2'565'190.70	-29'793.15
Total Aufwand		2'534'665.02	-64'219.49
Nettoertrag / Verlust		-10'214'388.77	907'614.99
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'126'038.81	-1'645'611.45
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		419'956.22	283'102.81
Realisierter Erfolg		-12'920'471.36	-454'893.65
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		6'076'594.93	-41'159'451.28
Gesamterfolg		-6'843'876.43	-41'614'344.93

Verwendung des Erfolges

Klasse FAH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	-403'828.16	19'088.26
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	403'828.16	0.00
Vortrag des Vorjahres	6'406.52	13'738.23
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6'406.52	32'826.49
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	6'203.46	26'419.97
Vortrag auf neue Rechnung	203.06	6'406.52
Total	6'406.52	32'826.49
Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	-8'072'484.65	888'526.73
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	8'072'484.65	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	888'526.73
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	310'984.36
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	577'542.37
Total	0.00	888'526.73
Klasse STH1 CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	-1'738'075.96	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	1'738'075.96	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							288'588'829.28	99.21	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							288'588'829.28	99.21	
AU0000024044	1.0000 % ACGB 1 02/21/50 50CI	415	160	100	475 AUD	97.62%	265'879.76	0.09	a)
AU0000171134	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/32 32CI	370	230	50	550 AUD	101.86%	321'225.46	0.11	a)
AU0000XCLWP8	3.0000 % ACGB 3 09/20/25 25CI	798	330	190	938 AUD	149.69%	805'048.39	0.28	a)
AU0000XCLWV6	2.5000 % ACGB 2 1/2 09/20/30 30CI	664	330	150	844 AUD	151.03%	730'875.85	0.25	a)
AU000XCLWAF4	2.0000 % ACGB 2 08/21/35 35CI	431	200	100	531 AUD	135.79%	413'431.70	0.14	a)
AU000XCLWAO6	1.2500 % ACGB 1 1/4 08/21/40 40CI	418	260	90	588 AUD	116.28%	392'038.41	0.13	a)
AU000XCLWAV1	0.7500 % ACGB 0 3/4 11/21/27 27CI	665	290	140	815 AUD	120.17%	561'555.06	0.19	a)
AUD							3'490'054.63	1.20	
CA135087B949	1.2500 % CANRRB 1 1/4 12/01/47 CPI	720	290	170	840 CAD	116.23%	633'855.90	0.22	a)
CA135087G997	0.5000 % CANRRB 0 1/2 12/01/50 CPI	750	290	180	860 CAD	92.27%	515'173.87	0.18	a)
CA135087M433	0.2500 % CANRRB 0 1/4 12/01/54 CPI	170	50	0	220 CAD	78.42%	112'001.32	0.04	a)
CA135087VS05	4.2500 % CANRRB 4 1/4 12/01/26 CPI	476	190	110	556 CAD	192.63%	695'317.02	0.24	a)
CA135087VW25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	530	210	120	620 CAD	202.13%	813'584.35	0.28	a)
CA135087XQ21	3.0000 % CANRRB 3 12/01/36 CPI	539	210	130	619 CAD	173.73%	698'155.11	0.24	a)
CA135087YK42	2.0000 % CANRRB 2 12/01/41 CPI	613	240	150	703 CAD	145.83%	665'535.51	0.23	a)
CA135087ZH04	1.5000 % CANRRB 1 1/2 12/01/44 CPI	718	330	170	878 CAD	130.34%	742'938.65	0.26	a)
CAD							4'876'561.73	1.68	
DE0001030559	0.5000 % DBRI 0 1/2 04/15/30 I/L	2'198	1'190	760	2'628 EUR	125.09%	3'132'540.53	1.08	a)
DE0001030567	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/26 I/L	1'852	820	480	2'192 EUR	121.53%	2'538'453.61	0.87	a)
DE0001030575	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/46 I/L	1'323	790	460	1'653 EUR	118.59%	1'867'904.66	0.64	a)
DE0001030583	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/33 I/L	740	770	250	1'260 EUR	115.48%	1'386'530.55	0.48	a)
ES00000126A4	1.8000 % SPGBEI 1.8 11/30/24	1'130	350	1'480	0 EUR	124.19%	0.00	0.00	
ES00000127C8	1.0000 % SPGBEI 1 11/30/30	1'614	1'030	610	2'034 EUR	123.40%	2'391'690.52	0.82	a)
ES00000128S2	0.6500 % SPGBEI 0.65 11/30/27	1'405	980	470	1'915 EUR	121.92%	2'224'673.67	0.76	a)
ES0000012C12	0.7000 % SPGBEI 0.7 11/30/33	1'615	1'159	550	2'224 EUR	116.15%	2'461'390.67	0.85	a)
ES0000012M69	2.0500 % SPGBEI 2.05 11/30/39	0	430	20	410 EUR	112.30%	438'726.83	0.15	a)
FR0000186413	3.4000 % FRTR 3.4 07/25/29 OATI	907	580	330	1'157 EUR	169.10%	1'864'341.43	0.64	a)
FR0000188799	3.1500 % FRTR 3.15 07/25/32 OATE	1'148	680	430	1'398 EUR	184.38%	2'456'248.61	0.84	a)
FR0010447367	1.8000 % FRTR 1.8 07/25/40 OATE	1'278	760	540	1'498 EUR	162.49%	2'319'383.79	0.80	a)
FR0011008705	1.8500 % FRTR 1.85 07/25/27 OATE	2'246	1'340	850	2'736 EUR	137.82%	3'592'962.73	1.24	a)
FR0011427848	0.2500 % FRTR 0 1/4 07/25/24 OATE	1'627	170	1'797	0 EUR	123.53%	0.00	0.00	
FR0011982776	0.7000 % FRTR 0.7 07/25/30 OATE	1'712	910	620	2'002 EUR	125.22%	2'388'775.33	0.82	a)
FR0012558310	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/25 OATI	1'268	570	738	1'100 EUR	116.03%	1'216'207.17	0.42	a)
FR0013209871	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/47 OATE	1'296	700	480	1'516 EUR	104.62%	1'511'368.18	0.52	a)
FR0013238268	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/28 OATI	1'418	810	400	1'828 EUR	114.70%	1'997'903.88	0.69	a)
FR0013327491	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/36 OATE	1'128	660	300	1'488 EUR	112.04%	1'588'607.32	0.55	a)
FR0013410552	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/29 OATE	1'064	1'380	390	2'054 EUR	115.92%	2'268'818.74	0.78	a)
FR0013519253	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/26 OATE	1'180	710	430	1'460 EUR	115.95%	1'613'091.14	0.55	a)
FR0013524014	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/36 OATI	660	560	240	980 EUR	104.31%	974'112.08	0.33	a)
FR0014001N38	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/31 OATE	1'090	670	400	1'360 EUR	114.11%	1'478'838.11	0.51	a)
FR0014003N51	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/32 OATI	520	520	250	790 EUR	108.44%	816'319.33	0.28	a)
FR0014008181	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/53 OATE	450	420	130	740 EUR	95.89%	676'120.69	0.23	a)
FR001400AQH0	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/38 OATE	450	520	140	830 EUR	105.05%	830'801.99	0.29	a)
FR001400IKW5	0.5500 % FRTR 0.55 03/01/39 OATI	0	350	0	350 EUR	100.27%	334'398.65	0.11	a)
FR001400JH88	0.6000 % FRTR 0.6 07/25/34 OATE	0	410	30	380 EUR	106.18%	384'475.73	0.13	a)
IT0003745541	2.3500 % BTPS 2.35 09/15/35 CPI	1'295	720	500	1'515 EUR	156.16%	2'254'374.15	0.77	a)
IT0004545890	2.5500 % BTPS 2.55 09/15/41 CPI	1'285	820	460	1'645 EUR	143.81%	2'254'197.96	0.77	a)
IT0004735152	3.1000 % BTPS 3.1 09/15/26 CPI	1'250	670	480	1'440 EUR	137.26%	1'883'414.28	0.65	a)
IT0005004426	2.3500 % BTPS 2.35 09/15/24 CPI	1'094	300	1'394	0 EUR	122.99%	0.00	0.00	
IT0005138828	1.2500 % BTPS 1 1/4 09/15/32 CPI	1'449	740	490	1'699 EUR	119.80%	1'939'533.28	0.67	a)
IT0005246134	1.3000 % BTPS 1.3 05/15/28 CPI	1'573	850	560	1'863 EUR	122.80%	2'179'930.93	0.75	a)
IT0005387052	0.4000 % BTPS 0.4 05/15/30 CPI	1'369	810	580	1'599 EUR	111.27%	1'695'442.43	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 CHF	in % 7)	Kat.
IT0005415416	0.6500 % BTPS 0.65 05/15/26 CPI	940	380	240	1'080 EUR	115.77%	1'191'376.73	0.41	a)
IT0005436701	0.1500 % BTPS 0.15 05/15/51 CPI	680	355	240	795 EUR	75.73%	573'649.13	0.20	a)
IT0005482994	0.1000 % BTPS 0.1 05/15/33 CPI	1'070	1'350	400	2'020 EUR	98.56%	1'897'095.22	0.65	a)
IT0005543803	1.5000 % BTPS 1 1/2 05/15/29 CPI	0	1'040	50	990 EUR	102.15%	963'632.80	0.33	a)
IT0005547812	2.4000 % BTPS 2.4 05/15/39 CPI	0	690	30	660 EUR	105.41%	662'917.06	0.23	a)
EUR							62'250'249.91	21.40	
GB0008932666	4.1250 % UKTI 4 1/8 07/22/30 8MO	428	210	140	498 GBP	340.25%	1'887'377.12	0.65	a)
GB0008983024	2.5000 % UKTI 2 1/2 07/17/24 8MO	599	10	609	0 GBP	382.21%	0.00	0.00	
GB0031790826	2.0000 % UKTI 2 01/26/35 8MO	816	440	290	966 GBP	243.66%	2'621'702.44	0.90	a)
GB00B0CNHZ09	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/55 3MO	969	570	390	1'149 GBP	197.59%	2'528'785.27	0.87	a)
GB00B128DH60	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/27 3MO	1'378	760	520	1'618 GBP	201.41%	3'629'781.47	1.25	a)
GB00B1L6W962	1.1250 % UKTI 1 1/8 11/22/37 3MO	1'273	820	600	1'493 GBP	194.57%	3'235'716.94	1.11	a)
GB00B24FFM16	0.7500 % UKTI 0 3/4 11/22/47 3MO	1'153	660	460	1'353 GBP	164.19%	2'474'483.57	0.85	a)
GB00B3D4VD98	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/32 3MO	1'456	900	650	1'706 GBP	186.62%	3'546'221.41	1.22	a)
GB00B3LZBF68	0.6250 % UKTI 0 5/8 03/22/40 3MO	1'378	810	550	1'638 GBP	165.37%	3'017'232.27	1.04	a)
GB00B3MYD345	0.6250 % UKTI 0 5/8 11/22/42 3MO	1'239	700	480	1'459 GBP	164.51%	2'673'514.54	0.92	a)
GB00B3Y1JG82	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/29 3MO	1'501	990	700	1'791 GBP	157.11%	3'134'139.60	1.08	a)
GB00B421JZ66	0.5000 % UKTI 0 1/2 03/22/50 3MO	1'209	670	460	1'419 GBP	147.67%	2'334'057.97	0.80	a)
GB00B46CGH68	0.7500 % UKTI 0 3/4 03/22/34 3MO	1'421	840	570	1'691 GBP	165.44%	3'116'117.45	1.07	a)
GB00B4PTCY75	0.3750 % UKTI 0 3/8 03/22/62 3MO	1'199	800	550	1'449 GBP	121.23%	1'956'597.85	0.67	a)
GB00B73ZYW09	0.2500 % UKTI 0 1/4 03/22/52 3MO	1'222	670	440	1'452 GBP	119.37%	1'930'511.13	0.66	a)
GB00B7RNOG65	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/44 3MO	1'519	900	600	1'819 GBP	126.99%	2'572'929.33	0.88	a)
GB00B855FQ54	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/24 3MO	1'341	0	1'341	0 GBP	155.86%	0.00	0.00	
GB00BD9MZZ71	0.1250 % UKTI 0 1/8 11/22/65 3MO	804	410	270	944 GBP	97.35%	1'023'636.73	0.35	a)
GB00BDX8CX86	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/68 3MO	1'243	720	500	1'463 GBP	100.37%	1'635'674.63	0.56	a)
GB00BGDYHF49	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/41 3MO	1'233	680	470	1'443 GBP	115.78%	1'860'929.50	0.64	a)
GB00BLH38265	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/39 3MO	710	700	210	1'200 GBP	112.66%	1'505'891.88	0.52	a)
GB00BM8Z2W66	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/2073 3MO	440	250	180	510 GBP	85.22%	484'117.69	0.17	a)
GB00BMF9LH90	0.6250 % UKTI 0 5/8 03/22/45 3MO	0	1'020	80	940 GBP	93.05%	974'292.78	0.33	a)
GB00BMF9LJ15	0.7500 % UKTI 0 3/4 11/22/33 3MO	0	1'180	40	1'140 GBP	103.87%	1'318'887.94	0.45	a)
GB00BNNGP551	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/31 3MO	1'110	660	420	1'350 GBP	127.31%	1'914'370.77	0.66	a)
GB00BNNGP882	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/51 3MO	655	800	190	1'265 GBP	95.31%	1'342'871.22	0.46	a)
GB00BP9DLZ64	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/58 3MO	1'090	580	400	1'270 GBP	103.47%	1'463'695.98	0.50	a)
GB00BYMVG366	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/46 3MO	1'338	710	480	1'568 GBP	115.70%	2'020'706.99	0.69	a)
GB00BYVP4K94	0.1250 % UKTI 0 1/8 11/22/56 3MO	700	390	250	840 GBP	101.19%	946'775.40	0.33	a)
GB00BY5F144	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/26 3MO	1'316	590	540	1'366 GBP	144.23%	2'194'464.52	0.75	a)
GB00BYZW3J87	0.1250 % UKTI 0 1/8 11/22/36 3MO	1'340	780	510	1'610 GBP	134.86%	2'418'467.25	0.83	a)
GB00BZ13DV40	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/48 3MO	1'123	670	430	1'363 GBP	105.35%	1'599'361.99	0.55	a)
GB00BZ1NTB69	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/28 3MO	1'746	1'030	690	2'086 GBP	134.38%	3'122'330.28	1.07	a)
GBP							66'485'643.91	22.86	
IL0010977085	4.0000 % ILCPI 4 05/30/36 0536	1'580	610	370	1'820 ILS	168.13%	754'429.01	0.26	a)
IL0011205833	2.7500 % ILCPI 2 3/4 08/30/41 0841	1'780	700	400	2'080 ILS	137.77%	706'471.75	0.24	a)
IL0011348658	1.0000 % ILCPI 1 05/31/45 0545	1'800	700	430	2'070 ILS	96.79%	493'944.79	0.17	a)
IL0011359127	0.7500 % ILCPI 0 3/4 10/31/25 1025	2'170	860	510	2'520 ILS	111.58%	693'243.02	0.24	a)
IL0011408478	0.7500 % ILCPI 0 3/4 05/31/27 0527	1'990	1'080	470	2'600 ILS	111.44%	714'318.33	0.25	a)
IL0011570236	0.5000 % ILCPI 0 1/2 05/31/29 0529	2'000	810	470	2'340 ILS	107.03%	617'475.80	0.21	a)
IL0011683013	0.5000 % ILCPI 0 1/2 11/30/51 1151	1'030	1'140	160	2'010 ILS	78.50%	389'012.76	0.13	a)
IL0011695645	0.1000 % ILCPI 0.1 07/31/26 0726	1'440	1'100	180	2'360 ILS	109.06%	634'583.16	0.22	a)
IL0011722209	0.1000 % ILCPI 0.1 11/30/31 1131	1'470	2'260	210	3'520 ILS	99.82%	866'285.61	0.30	a)
IL0011973265	1.1000 % ILCPI 1.1 10/31/28 1028	0	1'070	0	1'070 ILS	100.08%	264'017.86	0.09	a)
IL0095904319	4.0000 % GALIL 4 07/31/24 5904	1'400	0	1'400	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
ILS							6'133'782.09	2.11	
MX0SGO000015	4.5000 % MUDI 4 1/2 12/04/25 S	35'700	11'000	8'800	37'900 MXN	779.97%	1'525'202.77	0.52	a)
MX0SGO000023	4.5000 % MUDI 4 1/2 11/22/35 S	46'200	26'300	15'100	57'400 MXN	802.75%	2'377'394.69	0.82	a)
MX0SGO000098	4.0000 % MUDI 4 11/15/40 S	46'500	23'500	15'900	54'100 MXN	750.40%	2'094'587.54	0.72	a)
MX0SGO0000E3	4.0000 % MUDI 4 11/08/46 S	40'900	20'200	12'500	48'600 MXN	746.00%	1'870'615.95	0.64	a)
MX0SGO0000F0	4.0000 % MUDI 4 11/30/28 S	46'850	23'000	15'400	54'450 MXN	779.85%	2'190'868.85	0.75	a)
MX0SGO0000H6	4.0000 % MUDI 4 11/03/50 S	49'200	45'800	17'200	77'800 MXN	737.73%	2'961'323.50	1.02	a)
MX0SGO0000K0	2.7500 % MUDI 2 3/4 11/27/31 S	34'300	42'600	10'900	66'000 MXN	704.36%	2'398'549.46	0.82	a)
MX0SGO0000M6	3.0000 % MUDI 3 12/03/26 S	21'500	27'500	6'800	42'200 MXN	750.78%	1'634'692.91	0.56	a)
MX0SGO0000N4	3.2500 % MUDI 3 1/4 11/12/43 S	0	19'600	0	19'600 MXN	662.76%	670'224.36	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
MXN							17'723'460.03	6.09	
NZIBDT002C2	2.0000 % NZGBI 2 09/20/25 0925	290	120	60	350 NZD	131.07%	246'105.66	0.08	a)
NZIBDT003C0	3.0000 % NZGBI 3 09/20/30 0930	380	160	90	450 NZD	134.38%	324'407.82	0.11	a)
NZIBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	640	280	160	760 NZD	124.94%	509'406.09	0.18	a)
NZIBDT005C5	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/40 0940	440	170	100	510 NZD	119.69%	327'480.88	0.11	a)
NZD							1'407'400.45	0.48	
SE0000556599	3.5000 % SGBI 3 1/2 12/01/28 #3104 3104	2'790	1'100	670	3'220 SEK	177.88%	487'406.67	0.17	a)
SE0005703550	1.0000 % SGBI 1 06/01/25 #3109 3109	3'530	1'400	810	4'120 SEK	129.48%	453'970.15	0.16	a)
SE0007045745	0.1250 % SGBI 0 1/8 06/01/32 #3111 3111	2'310	1'120	510	2'920 SEK	123.50%	306'871.41	0.11	a)
SE0008014062	0.1250 % SGBI 0 1/8 06/01/26 #3112 3112	3'210	1'420	720	3'910 SEK	127.20%	423'227.92	0.15	a)
SE0009548704	0.1250 % SGBI 0 1/8 12/01/27 #3113 3113	2'470	1'100	540	3'030 SEK	124.04%	319'829.16	0.11	a)
SE0013748258	0.1250 % SGBI 0 1/8 06/01/30 #3114 3114	2'000	970	470	2'500 SEK	115.29%	245'272.33	0.08	a)
SEK							2'236'577.64	0.77	
US912810FD55	3.6250 % TII 3 5/8 04/15/28	831	440	300	971 USD	201.82%	1'725'570.29	0.59	a)
US912810FH69	3.8750 % TII 3 7/8 04/15/29	979	550	380	1'149 USD	204.13%	2'065'295.83	0.71	a)
US912810FR42	2.3750 % TII 2 3/8 01/15/25	1'616	250	1'866	0 USD	162.86%	0.00	0.00	
US912810FS25	2.0000 % TII 2 01/15/26	1'099	550	360	1'289 USD	154.14%	1'749'577.89	0.60	a)
US912810PS15	2.3750 % TII 2 3/8 01/15/27	1'083	540	360	1'263 USD	153.56%	1'707'829.45	0.59	a)
US912810PV44	1.7500 % TII 1 3/4 01/15/28	1'053	580	400	1'233 USD	145.26%	1'577'096.71	0.54	a)
US912810PZ57	2.5000 % TII 2 1/2 01/15/29	997	490	320	1'167 USD	146.83%	1'508'833.86	0.52	a)
US912810QF84	2.1250 % TII 2 1/8 02/15/40	606	320	220	706 USD	143.63%	892'919.71	0.31	a)
US912810QP66	2.1250 % TII 2 1/8 02/15/41	891	500	350	1'041 USD	141.83%	1'300'072.08	0.45	a)
US912810QV35	0.7500 % TII 0 3/4 02/15/42	1'491	850	600	1'741 USD	108.31%	1'660'359.07	0.57	a)
US912810RA88	0.6250 % TII 0 5/8 02/15/43	1'184	720	510	1'394 USD	102.19%	1'254'378.23	0.43	a)
US912810RF75	1.3750 % TII 1 3/8 02/15/44	1'655	890	610	1'935 USD	115.15%	1'961'946.53	0.67	a)
US912810RL44	0.7500 % TII 0 3/4 02/15/45	1'844	1'260	950	2'154 USD	99.65%	1'890'101.32	0.65	a)
US912810RR14	1.0000 % TII 1 02/15/46	951	480	310	1'121 USD	103.49%	1'021'516.11	0.35	a)
US912810RW09	0.8750 % TII 0 7/8 02/15/47	1'193	650	440	1'403 USD	97.93%	1'209'798.97	0.42	a)
US912810SB52	1.0000 % TII 1 02/15/48	883	540	390	1'033 USD	97.86%	890'164.00	0.31	a)
US912810SG40	1.0000 % TII 1 02/15/49	849	440	300	989 USD	95.50%	831'699.11	0.29	a)
US912810SM18	0.2500 % TII 0 1/4 02/15/50	1'306	800	580	1'526 USD	75.11%	1'009'262.73	0.35	a)
US912810SV17	0.1250 % TII 0 1/8 02/15/51	1'330	770	540	1'560 USD	70.36%	966'497.67	0.33	a)
US912810TE82	0.1250 % TII 0 1/8 02/15/52	1'650	990	700	1'940 USD	64.82%	1'107'339.16	0.38	a)
US912810TP30	1.5000 % TII 1 1/2 02/15/53	700	1'750	470	1'980 USD	90.14%	1'571'498.17	0.54	a)
US9128282L36	0.3750 % TII 0 3/8 07/15/27	2'807	1'650	1'060	3'397 USD	119.28%	3'568'051.74	1.23	a)
US9128283R96	0.5000 % TII 0 1/2 01/15/28	2'988	1'620	1'110	3'498 USD	117.63%	3'623'293.82	1.25	a)
US9128285W63	0.8750 % TII 0 7/8 01/15/29	2'292	1'240	860	2'672 USD	115.69%	2'722'089.26	0.94	a)
US9128286N55	0.5000 % TII 0 1/2 04/15/24	1'842	0	1'842	0 USD	121.89%	0.00	0.00	
US9128287D64	0.2500 % TII 0 1/4 07/15/29	2'735	1'460	990	3'205 USD	110.31%	3'113'007.51	1.07	a)
US912828H458	0.2500 % TII 0 1/4 01/15/25	2'875	1'440	4'315	0 USD	127.30%	0.00	0.00	
US912828N712	0.6250 % TII 0 5/8 01/15/26	2'658	1'670	1'100	3'228 USD	125.54%	3'568'500.46	1.23	a)
US912828S505	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/26	2'772	1'530	1'060	3'242 USD	122.65%	3'501'315.58	1.20	a)
US912828V491	0.3750 % TII 0 3/8 01/15/27	2'598	1'430	980	3'048 USD	121.15%	3'251'591.02	1.12	a)
US912828WU04	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/24	3'266	60	3'326	0 USD	129.29%	0.00	0.00	
US912828XL95	0.3750 % TII 0 3/8 07/15/25	3'165	1'600	940	3'825 USD	126.52%	4'261'317.46	1.46	a)
US912828Y388	0.7500 % TII 0 3/4 07/15/28	2'553	1'550	1'000	3'103 USD	116.65%	3'187'175.80	1.10	a)
US912828YL86	0.1250 % TII 0 1/8 10/15/24	3'146	130	3'276	0 USD	115.69%	0.00	0.00	
US912828Z377	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/30	3'007	1'850	1'210	3'647 USD	107.49%	3'451'807.56	1.19	a)
US912828ZJ22	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/25	2'600	1'110	670	3'040 USD	115.78%	3'099'360.03	1.07	a)
US912828ZZ63	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/30	3'430	1'910	1'320	4'020 USD	107.39%	3'801'552.06	1.31	a)
US91282CAQ42	0.1250 % TII 0 1/8 10/15/25	3'170	1'440	900	3'710 USD	114.73%	3'747'945.16	1.29	a)
US91282CBF77	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/31	3'510	2'240	1'530	4'220 USD	104.41%	3'879'877.09	1.33	a)
US91282CCA71	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/26	2'480	1'270	850	2'900 USD	112.07%	2'861'729.14	0.98	a)
US91282CCM10	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/31	3'790	2'120	1'470	4'440 USD	100.96%	3'947'308.66	1.36	a)
US91282CDC29	0.1250 % TII 0 1/8 10/15/26	3'470	2'020	1'310	4'180 USD	107.11%	3'942'559.39	1.36	a)
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	4'280	2'430	1'690	5'020 USD	96.34%	4'258'558.11	1.46	a)
US91282CEJ62	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/27	3'770	2'060	1'420	4'410 USD	102.38%	3'975'476.57	1.37	a)
US91282CEZ05	0.6250 % TII 0 5/8 07/15/32	4'560	2'710	1'810	5'460 USD	95.46%	4'589'650.86	1.58	a)
US91282CFR79	1.6250 % TII 1 5/8 10/15/27	3'970	2'150	1'480	4'640 USD	102.63%	4'193'249.77	1.44	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CGK18	1.1250 % Til 1 1/8 01/15/33	1'690	4'890	1'120	5'460	USD	96.37%	4'633'078.78	1.59 a)
US91282CGW55	1.2500 % Til 1 1/4 04/15/28	0	5'210	570	4'640	USD	99.31%	4'057'597.08	1.39 a)
US91282CHP95	1.3750 % Til 1 3/8 07/15/33	0	5'510	70	5'440	USD	96.71%	4'632'603.79	1.59 a)
US91282CJH51	2.3750 % Til 2 3/8 10/15/28	0	5'170	290	4'880	USD	102.50%	4'404'493.91	1.51 a)
US91282CJY84	1.7500 % Til 1 3/4 01/15/34	0	2'200	110	2'090	USD	98.36%	1'810'151.39	0.62 a)
USD								123'985'098.89	42.62

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/MXN	Verfall 27.12.2023	39'300'000	1'980'991		MXN/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 27.12.2023	8'270'000	9'017'831		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/NZD	Verfall 27.12.2023	320'000	173'244		NZD/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 27.12.2023	870'000	562'192		CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall 27.12.2023	3'010'000	255'564		SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 27.12.2023	730'000	425'565		AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 27.12.2023	19'460'000	16'750'312		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 27.12.2023	9'080'000	8'578'339		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/NZD	Verfall 28.12.2023	200'000	107'664		NZD/CHF	0.00	0.00
CHF/MXN	Verfall 28.12.2023	21'100'000	1'060'587		MXN/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 28.12.2023	9'870'000	8'457'129		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 28.12.2023	4'470'000	4'209'363		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 28.12.2023	510'000	296'556		AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 28.12.2023	650'000	418'477		CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 28.12.2023	4'310'000	4'673'303		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall 28.12.2023	1'640'000	138'983		SEK/CHF	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

MXN/CHF	Verfall 04.04.2023	12'125'947	239'444'000		CHF/MXN	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 04.04.2023	1'244'065	2'150'000		CHF/NZD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.04.2023	107'380'052	114'980'000		CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 04.04.2023	60'812'435	53'753'000		CHF/GBP	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 04.04.2023	1'933'950	21'559'000		CHF/SEK	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall 04.04.2023	5'118'664	20'004'000		CHF/ILS	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.04.2023	53'072'374	53'489'000		CHF/EUR	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 04.04.2023	2'962'978	4'699'000		CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 04.04.2023	4'584'308	6'681'000		CHF/CAD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 04.04.2023	138'325	123'000		CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.04.2023	363'193	388'000		CHF/USD	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023	98'000	98'096		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 04.04.2023	6'681'000	4'509'475		CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 04.04.2023	4'699'000	2'874'848		AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/NZD	Verfall 04.04.2023	2'150'000	1'228'768		NZD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 04.04.2023	53'391'000	52'986'296		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/MXN	Verfall 04.04.2023	239'444'000	12'113'783		MXN/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 04.04.2023	53'876'000	60'850'787		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 04.04.2023	115'368'000	105'386'361		USD/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall 04.04.2023	21'559'000	1'899'132		SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/ILS	Verfall 04.04.2023	20'004'000	5'075'015		ILS/CHF	0.00	0.00
CHF/ILS	Verfall 02.05.2023	1'770'000	436'659		ILS/CHF	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.05.2023	4'536'734	6'740'000		CHF/CAD	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 03.05.2023	2'996'339	4'908'000		CHF/AUD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023	55'144'420	55'650'000		CHF/EUR	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 03.05.2023	1'283'624	2'253'000		CHF/NZD	0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall 03.05.2023	12'786'788	255'010'000		CHF/MXN	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.05.2023	63'910'048	56'728'000		CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.05.2023	110'981'318	121'877'000		CHF/USD	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 03.05.2023	1'922'939	21'864'000		CHF/SEK	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall 03.05.2023	5'123'098	20'247'000		CHF/ILS	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 03.05.2023	332'000	374'795		GBP/CHF	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023	386'980	390'000		CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.05.2023	464'969	511'000		CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.05.2023	244'685	220'000		CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.05.2023	743'697	833'000		CHF/USD	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall 03.05.2023	6'524'000	7'295'124		GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall 03.05.2023	5'807'000	5'734'616		EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/MXN	Verfall 03.05.2023	27'508'000	1'364'974		MXN/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		208'000	114'294	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		2'105'000	183'108	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		461'000	273'521	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		736'000	484'884	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		15'792'000	14'160'497	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		50'233'000	49'365'476	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		50'092'000	56'042'429	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		19'759'000	1'714'686	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		4'447'000	2'615'903	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.05.2023		227'502'000	11'225'927	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		2'045'000	1'124'300	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		6'004'000	3'940'365	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		107'429'000	95'624'701	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.05.2023		20'247'000	4'956'061	ILS/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		41'805'825	42'614'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		45'300'868	40'604'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		1'436'443	16'585'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		2'248'114	3'830'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.06.2023		9'410'629	192'587'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		952'711	1'739'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		3'363'642	5'140'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		80'882'993	91'182'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		88'251	99'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		543'484	489'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		448'028	457'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		47'130	72'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		680'346	769'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		1'208'494	1'243'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		3'079'201	3'429'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		1'218'236	1'088'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		484'001	535'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		3'830'000	2'265'981	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		96'014'000	87'777'919	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		44'314'000	43'182'664	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		42'181'000	47'794'869	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		5'212'000	3'505'435	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.06.2023		1'739'000	952'868	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		16'585'000	1'392'808	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.06.2023		192'587'000	9'913'108	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		17'412'000	4'261'430	ILS/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		3'816'942	15'640'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		433'479	1'772'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2023		44'321'000	43'263'058	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.07.2023		199'842'000	10'425'517	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.07.2023		39'032'000	44'391'484	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.07.2023		3'795'000	2'260'188	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.07.2023		93'169'000	83'360'168	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.07.2023		1'710'000	937'183	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.07.2023		15'859'000	3'822'971	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.07.2023		5'124'000	3'464'593	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.07.2023		16'862'000	1'396'848	SEK/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		2'239'422	3'795'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		43'325'002	44'545'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		84'701'157	93'009'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		44'217'795	39'146'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.07.2023		933'236	1'710'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		3'435'883	5'124'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		1'413'171	16'862'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		9'902'795	194'518'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.07.2023		3'838'030	15'719'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		461'768	407'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		136'297	140'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.07.2023		33'893	140'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		89'659	99'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		1'201'900	1'327'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		198'842	205'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.07.2023		274'941	5'324'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		569'000	551'516	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		521'000	587'088	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		1'266'000	1'137'596	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		43'073'817	44'195'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		10'100'279	195'296'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		45'358'712	39'991'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		2'223'276	3'741'000	CHF/AUD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		82'501'310	92'483'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		935'923	1'713'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		3'840'994	15'972'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		3'379'494	5'011'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		1'378'295	16'666'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.08.2023		21'000	11'560		NZD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		151'292	155'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		1'384'186	1'549'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		25'000	14'946		AUD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		151'980	134'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		50'661	75'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		15'726	302'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.08.2023		303'906	5'878'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		473'357	486'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		505'613	445'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		689'603	778'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		865'233	996'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		513'420	460'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		56'344	59'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		5'086'000	3'349'690		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		16'666'000	1'374'778		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.08.2023		1'692'000	912'851		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		3'716'000	2'170'516		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		44'895'000	42'906'152		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		95'806'000	83'045'599		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.08.2023		15'972'000	3'779'295		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.08.2023		201'476'000	10'455'960		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		41'030'000	45'763'221		GBP/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 01.09.2023		204'378	882'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2023		4'318'000	2'469'939		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2023		1'728'000	908'859		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.09.2023		242'493'000	12'725'523		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2023		18'664'000	1'505'625		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2023		46'101'000	51'599'005		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2023		52'167'000	50'009'895		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.09.2023		18'442'000	4'288'687		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		110'354'000	97'474'585		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2023		5'741'000	3'748'127		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		3'233'499	4'925'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		1'390'058	16'885'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		902'118	1'678'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		2'178'622	3'739'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		43'879'903	46'004'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		84'568'962	97'911'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		3'751'644	15'897'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		11'076'872	215'500'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		45'364'528	40'811'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		396'361	1'663'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		313'908	328'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		182'670	319'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		267'406	241'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		232'733	355'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		26'584	50'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		468'742	536'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		11'875	233'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		5'631'584	5'049'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.09.2023		1'397'664	26'760'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		10'434'521	11'907'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		144'135	1'779'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		298'593	461'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		148'026	260'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		5'589'463	5'835'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		2'468'377	4'324'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.10.2023		897'752	1'712'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.10.2023		12'389'706	237'994'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		1'490'864	18'512'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		49'848'283	44'667'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		48'757'553	50'947'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		4'235'987	18'254'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		95'139'624	108'042'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		3'676'280	5'646'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.10.2023		326'000	16'702		MXN/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		13'103	23'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		15'338	66'000		CHF/ILS	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		482'805	434'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		9'740	15'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		138'316	145'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		100'484	114'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.10.2023		18'320'000	4'402'479		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		18'512'000	1'558'896		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		51'092'000	49'487'711		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		4'347'000	2'566'825		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		108'156'000	98'946'517		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		5'661'000	3'830'572		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		45'101'000	50'360'228		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.10.2023		237'668'000	12'511'414		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.10.2023		1'712'000	941'052		NZD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2023		4'312'281	17'982'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		1'544'794	18'381'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		45'724'674	47'300'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		2'501'807	4'246'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		96'164'173	105'453'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'660'660	5'425'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		47'171'658	42'373'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		919'438	1'678'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		337'049	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		231'000	211'691		USD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		23'477	35'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		482'099	434'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		6'239	75'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		847'849	925'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		417'605	376'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		86'653	90'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		461'106	421'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		139'498	263'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		51'428	78'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		85'478	149'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		628'520	699'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		120'763	1'465'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		465'319	489'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		859'000	189'023		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		5'538'000	3'630'381		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		19'921'000	1'622'366		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		4'395'000	2'532'531		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.11.2023		234'116'000	11'801'179		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		43'604'000	48'149'281		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		48'229'000	46'391'475		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		1'941'000	1'027'488		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		106'846'000	97'229'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		17'123'000	3'851'990		ILS/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		12'299'792	235'658'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.11.2023		1'542'000	80'057		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'620'268	5'539'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		1'620'018	19'935'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		2'496'682	4'343'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.12.2023		12'904'165	258'200'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		51'461'894	46'754'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		51'234'874	53'377'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		1'012'499	1'919'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		104'496'560	115'222'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		3'624'943	16'153'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		338'000	306'720		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		33'506	35'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		291'561	265'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		3'995'000	4'436'923		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		9'351'000	8'178'787		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		4'214'000	4'045'512		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		18'270'000	929'209		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		19'935'000	1'654'007		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		4'343'000	2'503'870		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.12.2023		239'930'000	12'009'360		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		105'533'000	91'761'999		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		5'539'000	3'552'161		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.12.2023		1'919'000	1'030'599		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		43'024'000	47'358'238		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		49'198'000	46'674'143		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		16'153'000	3'771'402		ILS/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		1'675'969	20'238'000		CHF/SEK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		2'574'566	4'477'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.01.2024		12'671'386	255'350'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		94'656'675	109'255'000	CHF/USD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'070'979	2'001'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		3'803'422	5'949'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		49'785'883	45'378'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		47'663'152	50'347'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.01.2024		3'957'751	16'997'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 04.01.2024		1'747'000	87'475	MXN/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'118'088	1'286'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.01.2024		16'000	10'297	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.01.2024		23'000	13'285	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.01.2024		49'000	53'837	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 04.01.2024		42'000	9'840	ILS/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		666'970	707'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		16'332'726	18'993'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		8'386'589	8'882'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.01.2024		1'925'787	38'296'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		8'419'440	7'728'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		541'710	839'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.01.2024		892'422	3'764'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.01.2024		169'840	314'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.01.2024		251'528	2'964'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		410'722	705'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		397'566	618'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.01.2024		103'268	192'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.01.2024		1'022'708	20'389'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		8'238'856	9'624'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		4'187'353	3'865'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.01.2024		415'851	1'761'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		3'976'701	4'225'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		281'255	484'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.01.2024		131'293	1'550'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.01.2024		5'643'000	3'240'606	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 04.01.2024		24'752'000	2'066'792	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.01.2024		56'922'000	61'071'614	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 04.01.2024		2'507'000	1'335'880	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.01.2024		7'390'000	4'716'741	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		139'158'000	117'116'764	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.01.2024		64'161'000	59'647'274	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 04.01.2024		22'480'000	5'254'026	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 04.01.2024		312'288'000	15'520'027	MXN/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2024		3'396'827	5'928'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024		66'831'171	62'472'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2024		2'108'350	25'300'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'390'294	2'617'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		4'851'148	7'621'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		124'187'447	148'017'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		61'974'567	66'791'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 02.02.2024		15'882'223	322'071'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.02.2024		21'000	11'997	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2024		72'000	61'207	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2024		971'000	901'199	EUR/CHF		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 02.02.2024		930'230	18'739'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		11'465	18'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 02.02.2024		727'594	14'657'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2024		111'000	103'021	EUR/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024		130'987	122'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 02.02.2024		9'552'000	473'240	MXN/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		100'375	108'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 02.02.2024		22'778'000	5'370'870	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2024		65'817'000	61'331'571	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 02.02.2024		2'617'000	1'381'985	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 02.02.2024		345'915'000	17'277'970	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 02.02.2024		25'300'000	2'100'912	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.02.2024		62'594'000	68'380'815	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.02.2024		7'639'000	4'905'078	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.02.2024		5'907'000	3'349'919	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2024		147'945'000	126'920'536	USD/CHF		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.02.2024		5'307'092	22'778'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		60'215'993	64'752'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'340'570	2'547'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.03.2024		16'739'134	338'010'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.03.2024		2'076'763	25'062'000	CHF/SEK		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
GBP/CHF	Verfall 04.03.2024		63'708'219	58'499'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
CAD/CHF	Verfall 04.03.2024		4'709'473	7'356'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
AUD/CHF	Verfall 04.03.2024		3'294'316	5'823'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		120'908'424	141'417'000		CHF/USD	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		768'232	825'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'745'376	2'032'000		CHF/USD	0.00	0.00		
MXN/CHF	Verfall 04.03.2024		73'831	1'478'000		CHF/MXN	0.00	0.00		
AUD/CHF	Verfall 04.03.2024		18'009	32'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall 04.03.2024		1'388'233	1'274'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
CAD/CHF	Verfall 04.03.2024		42'918	67'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
AUD/CHF	Verfall 04.03.2024		163'558	289'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		305'582	352'000		CHF/USD	0.00	0.00		
CAD/CHF	Verfall 04.03.2024		102'739	160'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
MXN/CHF	Verfall 04.03.2024		228'658	4'510'000		CHF/MXN	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		805'900	855'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'853'647	2'123'000		CHF/USD	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall 04.03.2024		1'092'172	990'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall 04.03.2024		308'089	276'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
SEK/CHF	Verfall 04.03.2024		125'812	1'471'000		CHF/SEK	0.00	0.00		
NZD/CHF	Verfall 04.03.2024		43'460	80'000		CHF/NZD	0.00	0.00		
MXN/CHF	Verfall 04.03.2024		259'325	5'053'000		CHF/MXN	0.00	0.00		
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		187'447	213'000		CHF/USD	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		812'824	851'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
CHF/MXN	Verfall 04.03.2024		349'051'000	18'010'264		MXN/CHF	0.00	0.00		
CHF/CAD	Verfall 04.03.2024		7'583'000	4'923'187		CAD/CHF	0.00	0.00		
CHF/SEK	Verfall 04.03.2024		26'533'000	2'258'224		SEK/CHF	0.00	0.00		
CHF/NZD	Verfall 04.03.2024		2'627'000	1'409'254		NZD/CHF	0.00	0.00		
CHF/GBP	Verfall 04.03.2024		61'039'000	67'991'952		GBP/CHF	0.00	0.00		
CHF/USD	Verfall 04.03.2024		146'137'000	128'686'781		USD/CHF	0.00	0.00		
CHF/ILS	Verfall 04.03.2024		24'925'000	6'144'723		ILS/CHF	0.00	0.00		
CHF/AUD	Verfall 04.03.2024		6'144'000	3'522'970		AUD/CHF	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall 04.03.2024		67'283'000	64'117'335		EUR/CHF	0.00	0.00		
ILS/CHF	Verfall 05.03.2024		5'303'753	22'547'000		CHF/ILS	0.00	0.00		
ILS/CHF	Verfall 05.03.2024		450'572	1'919'000		CHF/ILS	0.00	0.00		
ILS/CHF	Verfall 05.03.2024		110'943	459'000		CHF/ILS	0.00	0.00		
MXN/CHF	Verfall 03.04.2024		17'743'053	346'674'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)	
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024		4'867'281	7'518'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)	
SEK/CHF	Verfall 03.04.2024		2'240'070	26'373'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)	
NZD/CHF	Verfall 03.04.2024		1'414'329	2'645'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)	
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024		65'240'060	58'749'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)	
USD/CHF	Verfall 03.04.2024		123'559'981	140'773'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)	
ILS/CHF	Verfall 03.04.2024		6'160'797	25'050'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)	
AUD/CHF	Verfall 03.04.2024		3'487'880	6'097'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)	
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		62'144'075	65'345'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte auf Klassen								0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'416'451.33	0.49
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	288'588'829.28	99.21
Sonstige Vermögenswerte	891'918.22	0.31
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	290'897'198.83	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-2'043.59	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	290'895'155.24	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	288'588'829.28	99.21
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

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57337013
CAD	1 = CHF	0.64920559
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
ILS	1 = CHF	0.24654217
MXN	1 = CHF	0.05159523
NZD	1 = CHF	0.53647509
SEK	100 = CHF	8.50982600
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	287'763'948.78	98.924

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.35	-	0.235	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.35	-	0.235	-	-	-
STH1 CHF	CHF	0.00 - 0.35	-	0.235	-	-	-

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FAH1 CHF	0.250	0.550	0.150	0.100	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

Periode: 31.05.2023 - 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
STH1 CHF	-	-	-	-	3.000

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

8 Benchmark

FTSE Non-JPY World Inflation-Linked Securities Index TR

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FAH1 CHF	Ja	CHF	0.05000	0.01750	0.03250

11 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
NTH1 CHF	Ja	CHF	-	-	-
STH1 CHF	Ja	CHF	-	-	-

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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 Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

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

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

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

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

2.2 Umtauschverhältnisse

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

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

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

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

Zürich, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

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

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

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

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

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen sämtliche Arten von Effekten ausleihen, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen worden sind, dürfen hingegen nicht ausgeliehen werden.
2. Die Fondsleitung kann die Effekten im eigenen Namen und auf eigene Rechnung einem Borger ausleihen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, die Effekten entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") einem Borger zur Verfügung zu stellen.
3. Die Fondsleitung tätigt die Effektenleihe nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Borgern und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahrern, die eine einwandfreie Durchführung der Effektenleihe gewährleisten.
4. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben 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 angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art. 52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.
9. Forderungen aus Reverse Repo gelten als flüssige Mittel gemäss § 9 und nicht als Kreditgewährung gemäss § 13.
10. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

betreffend

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

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

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

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

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der 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