

SWISSCANTO (CH) INDEX COMMODITY FUND

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	31562189	CHF
NT USD	119692589	USD
NTH1 CHF	13250187	CHF
STH1 CHF	17008452	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	Collateral ausgeliehene Effekten	13
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
8	Pauschale Verwaltungskommission	14
9	Benchmark	14
10	TER	14
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	15
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	15
13	Fussnoten	15
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
15	Pflichtpublikationen	18

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		209'921'506.08	306'051'140.81	197'456'006.89	196'842'829.76
Klasse FAH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		18'336'881.16	19'782'528.71	16'401'519.59	18'957'607.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		195'357.755	185'313.679	138'085.604	210'390.025
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		93.8631	106.7516	118.7779	90.1070
Ausschüttung je Anteil		-	3.85	2.00	-
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse NT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		5'950'919.80	19'677'460.49		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		76'565.665	227'219.464		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		88.2665	92.3992		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		77.7231	86.6011		
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		-	0.68		
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %		
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		138'570'279.28	226'330'195.48	181'054'487.30	177'885'222.23
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'022'398.551	4'461'287.272	3'248'529.756	4'224'170.520
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		45.8478	50.7320	55.7343	42.1113
Thesaurierung je Anteil		-	2.00	1.18	-
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse STH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		47'063'425.84	40'260'956.13		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		632.964	485.261		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		74'354.0325	82'967.6321		
Thesaurierung je Anteil		-	5'181.77		
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %		

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FAH1 CHF	-8.73 %	-12.57 %	11.96 %	24.82 %
Klasse NT USD (Lancierung 01.07.2022)	-4.19 %	-8.17 %	-2.49 %	-
Klasse NTH1 CHF	-8.34 %	-12.21 %	12.40 %	25.32 %
Klasse STH1 CHF (Lancierung 11.03.2022)	-8.35 %	-12.21 %	-11.77 %	-
Benchmark Hedge	-8.03 %	-11.89 %	-	-
Benchmark	-3.94 %	-7.91 %	16.09 %	25.41 %
Tracking Error ³³⁾	0.14 %	0.15 %	0.35 %	0.08 %

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

Tracking Differenz

Klasse

Klasse FAH1 CHF	-0.70 %
Klasse NT USD (Lancierung 01.07.2022)	-0.25 %
Klasse NTH1 CHF	-0.31 %
Klasse STH1 CHF (Lancierung 11.03.2022)	-0.32 %

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	9'721'877.72	5'901'860.80
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	200'067'355.11	300'285'852.68
Sonstige Vermögenswerte	138'034.99	11'316.45
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	209'927'267.82	306'199'029.93
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-141'142.05
Andere Verbindlichkeiten	-5'761.74	-6'747.07
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	209'921'506.08	306'051'140.81

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		185'313.679	138'085.604
Ausgegebene Anteile		31'103.523	132'819.440
Zurückgenommene Anteile		-21'059.447	-85'591.365
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		195'357.755	185'313.679

Klasse NT USD	von bis	01.03.2023 29.02.2024	Lancierung 01.07.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		227'219.464	-
Ausgegebene Anteile		193'388.520	242'912.464
Zurückgenommene Anteile		-344'042.319	-15'693.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		76'565.665	227'219.464

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'461'287.272	3'248'529.756
Ausgegebene Anteile		535'233.278	3'519'717.644
Zurückgenommene Anteile		-1'974'121.999	-2'306'960.128
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'022'398.551	4'461'287.272

Klasse STH1 CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	Lancierung 11.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		485.261	-
Ausgegebene Anteile		148.952	576.584
Zurückgenommene Anteile		-1.249	-91.323
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		632.964	485.261

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		306'051'140.81	197'456'006.89
Ausbezahlte Ausschüttung		-715'058.11	-378'584.81
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'812'032.22	-1'344'634.42
Saldo aus dem Anteilverkehr		-74'846'207.74	139'540'731.98
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-16'756'336.66	-29'222'378.83
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		209'921'506.08	306'051'140.81

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		405'182.33	30'468.72
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-2'648.30
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		-7'580'012.33	7'525'736.97
Erträge aus Wertpapierleihe		90'692.00	36'660.55
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds-/anteilen		0.00	993'366.11
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-1'111'389.10	6'023'472.27
Total Ertrag		-8'195'527.10	14'607'056.32
Aufwand			
Passivzinsen		-17'641.20	-16.31
Reglementarische Vergütungen		-75'798.61	-86'655.85
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		3'726'174.67	-2'198'786.48
Total Aufwand		3'632'734.86	-2'285'458.64
Nettoertrag / Verlust		-4'562'792.24	12'321'597.68
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-26'905'530.60	-19'603'019.82
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		115'100.95	200'487.75
Realisierter Erfolg		-31'353'221.89	-7'080'934.39
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		14'596'885.23	-22'141'444.44
Gesamterfolg		-16'756'336.66	-29'222'378.83

Verwendung des Erfolges

Klasse FAH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	-482'330.80	705'376.33
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	482'330.80	0.00
Vortrag des Vorjahres	8'165.12	16'246.45
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	8'165.12	721'622.78
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	0.00	713'457.66
Vortrag auf neue Rechnung	8'165.12	8'165.12
Total	8'165.12	721'622.78

Klasse NT USD	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	-121'653.52	155'971.98
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	121'653.52	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	155'971.98
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	54'590.19
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	101'381.79
Total	0.00	155'971.98

Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	-2'946'633.70	8'945'734.22
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	2'946'633.70	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	8'945'734.22
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	3'131'006.98
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	5'814'727.24
Total	0.00	8'945'734.22

Klasse STH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	-1'012'174.22	2'514'515.15
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	1'012'174.22	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	2'514'515.15
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	880'080.30
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	1'634'434.85
Total	0.00	2'514'515.15

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							200'067'355.11	95.30	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							200'067'355.11	95.30	
US912796CQ02	0.0000 % B 09/14/23	0	16'000	16'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796CR84	0.0000 % B 09/21/23	0	14'000	14'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796CS67	0.0000 % B 09/28/23	0	16'000	16'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796U310	0.0000 % B 03/23/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796V482	0.0000 % B 04/20/23	12'000	0	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796W472	0.0000 % B 05/18/23	16'000	0	16'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796X538	0.0000 % B 06/15/23	14'000	0	14'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796XQ72	0.0000 % B 07/13/23	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796XY07	0.0000 % B 08/10/23	21'000	0	21'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Y296	0.0000 % B 07/27/23	13'000	0	13'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Y379	0.0000 % B 08/03/23	13'000	0	13'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YB94	0.0000 % B 03/02/23	12'000	0	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YH64	0.0000 % B 09/07/23	0	15'000	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YJ21	0.0000 % B 10/05/23	0	17'000	17'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YK93	0.0000 % B 03/09/23	11'000	0	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YL76	0.0000 % B 03/16/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YM59	0.0000 % B 03/30/23	12'000	0	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YN33	0.0000 % B 04/06/23	9'000	0	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YT03	0.0000 % B 11/02/23	0	20'000	20'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YU75	0.0000 % B 04/13/23	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YV58	0.0000 % B 04/27/23	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796YW32	0.0000 % B 05/04/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Z285	0.0000 % B 02/22/24	0	18'000	18'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Z368	0.0000 % B 08/17/23	0	16'000	16'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Z368XXX	0.0000 % B 08/17/23 *RETIRED*	12'000	0	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Z442	0.0000 % B 08/24/23	0	20'000	20'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796Z517	0.0000 % B 08/31/23	0	15'000	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZD42	0.0000 % B 11/30/23	0	17'000	17'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZE25	0.0000 % B 05/11/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZF99	0.0000 % B 05/25/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZG72	0.0000 % B 06/01/23	10'000	0	10'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZN24	0.0000 % B 12/28/23	0	17'000	17'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZP71	0.0000 % B 06/08/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZQ54	0.0000 % B 06/22/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZR38	0.0000 % B 06/29/23	9'000	5'000	14'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZS11	0.0000 % B 07/06/23	15'000	0	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZY88	0.0000 % B 01/25/24	0	15'000	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912796ZZ53	0.0000 % B 07/20/23	10'000	5'000	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FA06	0.0000 % B 10/12/23	0	11'000	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FB88	0.0000 % B 10/19/23	0	12'000	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FC61	0.0000 % B 10/26/23	0	12'000	12'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FH58	0.0000 % B 05/16/24	0	12'000	0	12'000 USD	98.91%	10'451'546.61	4.98	a)
US912797FJ15	0.0000 % B 11/09/23	0	9'000	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FK87	0.0000 % B 11/16/23	0	11'000	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FS14	0.0000 % B 06/13/24	0	9'000	0	9'000 USD	98.53%	7'808'325.14	3.72	a)
US912797FT96	0.0000 % B 12/07/23	0	13'000	13'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FU69	0.0000 % B 12/14/23	0	16'000	16'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FV43	0.0000 % B 12/21/23	0	11'000	11'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797FW26	0.0000 % B 01/04/24	0	13'000	13'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797GB79	0.0000 % B 07/11/24	0	10'000	0	10'000 USD	98.17%	8'644'199.48	4.12	a)
US912797GC52	0.0000 % B 01/11/24	0	17'000	17'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797GD36	0.0000 % B 01/18/24	0	15'000	15'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797GE19	0.0000 % B 02/01/24	0	9'000	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912797GK78	0.0000 % B 08/08/24	0	9'000	0	9'000 USD	97.80%	7'750'434.20	3.69	a)
US912797GL51	0.0000 % B 09/05/24	0	10'000	0	10'000 USD	97.47%	8'582'571.23	4.09	a)
US912797GN18	0.0000 % B 02/15/24	0	9'000	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797GP65	0.0000 % B 02/29/24	0	9'000	9'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912797GQ49	0.0000 % B 03/07/24	0	9'000	0	9'000 USD	99.90%	7'916'983.53	3.77	a)
US912797GW17	0.0000 % B 10/03/24	0	7'000	0	7'000 USD	97.16%	5'988'928.10	2.85	a)
US912797GX99	0.0000 % B 03/14/24	0	10'000	0	10'000 USD	99.80%	8'787'764.20	4.19	a)
US912797GY72	0.0000 % B 03/28/24	0	10'000	0	10'000 USD	99.60%	8'770'116.41	4.18	a)
US912797GZ48	0.0000 % B 04/04/24	0	12'000	0	12'000 USD	99.50%	10'513'490.36	5.01	a)
US912797HF74	0.0000 % B 04/11/24	0	13'000	0	13'000 USD	99.40%	11'378'193.02	5.42	a)
US912797HG57	0.0000 % B 04/25/24	0	13'000	0	13'000 USD	99.20%	11'355'413.16	5.41	a)
US912797HH31	0.0000 % B 05/02/24	0	17'000	0	17'000 USD	99.10%	14'834'842.36	7.07	a)
US912797HQ30	0.0000 % B 05/09/24	0	8'000	0	8'000 USD	99.01%	6'974'535.53	3.32	a)
US912797HR13	0.0000 % B 05/23/24	0	10'000	0	10'000 USD	98.81%	8'701'009.44	4.14	a)
US912797HS95	0.0000 % B 05/30/24	0	11'000	0	11'000 USD	98.72%	9'561'801.76	4.55	a)
US912797HT78	0.0000 % B 06/06/24	0	9'000	0	9'000 USD	98.63%	7'816'148.04	3.72	a)
US912797IS77	0.0000 % B 07/18/24	0	10'000	0	10'000 USD	98.07%	8'635'671.00	4.11	a)
US912797JT50	0.0000 % B 07/25/24	0	9'000	0	9'000 USD	97.99%	7'765'456.59	3.70	a)
US912797KB24	0.0000 % B 08/15/24	0	15'000	0	15'000 USD	97.71%	12'905'830.43	6.15	a)
US912797LL96	0.0000 % B 03/21/24	0	17'000	0	17'000 USD	99.70%	14'924'094.52	7.11	a)

USD **200'067'355.11** **95.30**

Derivative Finanzinstrumente **0.00** **0.00**

Futures **0.00** **0.00**

03/23	LME PRI ALUM FUTR MAR23	0	243	243	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	LME NICKEL FUTURE MAR23	0	72	72	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	LME LEAD FUTURE MAR23	0	57	57	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	LME ZINC FUTURE MAR23	0	131	131	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	BRENT CRUDE FUTR MAY23	309	0	309	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	LEAN HOGS FUTURE APR23	178	1	179	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	WTI CRUDE FUTURE MAY23	345	16	361	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	GOLD 100 OZ FUTR APR23	261	0	261	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	NATURAL GAS FUTR MAY23	769	35	804	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	NY HARB ULSD FUT MAY23	56	3	59	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	LIVE CATTLE FUTR APR23	174	0	174	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	SUGAR #11 (WORLD) MAY23	395	18	413	0 USD	0.00	0.00	0.00	
04/23	GASOLINE RBOB FUT MAY23	76	4	80	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	COTTON NO.2 FUTR MAY23	119	6	125	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	LOW SU GASOIL G MAY23	109	4	113	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	SOYBEAN OIL FUTR MAY23	283	13	296	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	CORN FUTURE MAY23	554	25	579	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	KC HRW WHEAT FUT MAY23	138	7	145	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	SOYBEAN FUTURE MAY23	255	11	266	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	SOYBEAN MEAL FUTR MAY23	243	11	254	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	WHEAT FUTURE(CBT) MAY23	247	11	258	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	LME PRI ALUM FUTR MAY23	236	260	496	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	LME NICKEL FUTURE MAY23	54	62	116	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	LME LEAD FUTURE MAY23	56	63	119	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	LME ZINC FUTURE MAY23	127	140	267	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	COFFEE 'C' FUTURE MAY23	158	7	165	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	COPPER FUTURE MAY23	176	8	184	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	SILVER FUTURE MAY23	126	5	131	0 USD	0.00	0.00	0.00	
05/23	BRENT CRUDE FUTR JUL23	0	334	334	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	LEAN HOGS FUTURE JUN23	0	197	197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	WTI CRUDE FUTURE JUL23	0	387	387	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	GOLD 100 OZ FUTR JUN23	0	289	289	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	NATURAL GAS FUTR JUL23	0	864	864	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	NY HARB ULSD FUT JUL23	0	64	64	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	LIVE CATTLE FUTR JUN23	0	192	192	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	SUGAR #11 (WORLD) JUL23	0	444	444	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	GASOLINE RBOB FUT JUL23	0	84	84	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	COTTON NO.2 FUTR JUL23	0	134	134	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	LOW SU GASOIL G JUL23	0	121	121	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	SOYBEAN OIL FUTR JUL23	0	319	319	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	CORN FUTURE JUL23	0	625	625	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	KC HRW WHEAT FUT JUL23	0	154	154	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
07/23	SOYBEAN FUTURE JUL23	0	287	287	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	SOYBEAN MEAL FUTR JUL23	0	272	272	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	WHEAT FUTURE(CBT) JUL23	0	276	276	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	LEAN HOGS FUTURE JUL23	0	201	201	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	LME PRI ALUM FUTR JUL23	0	526	526	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	LME NICKEL FUTURE JUL23	0	122	122	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	LME LEAD FUTURE JUL23	0	122	122	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	LME ZINC FUTURE JUL23	0	284	284	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	COFFEE 'C' FUTURE JUL23	0	180	180	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	COPPER FUTURE JUL23	0	198	198	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	SILVER FUTURE JUL23	0	141	141	0 USD	0.00	0.00	0.00	
07/23	BRENT CRUDE FUTR SEP23	0	354	354	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	LEAN HOGS FUTURE AUG23	0	179	179	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	WTI CRUDE FUTURE SEP23	0	356	356	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	GOLD 100 OZ FUTR AUG23	0	307	307	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	NATURAL GAS FUTR SEP23	0	793	793	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	NY HARB ULSD FUT SEP23	0	57	57	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	LIVE CATTLE FUTR AUG23	0	203	203	0 USD	0.00	0.00	0.00	
08/23	GASOLINE RBOB FUT SEP23	0	80	80	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	LOW SU GASOIL G SEP23	0	109	109	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	CORN FUTURE SEP23	0	571	571	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	KC HRW WHEAT FUT SEP23	0	142	142	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	WHEAT FUTURE(CBT) SEP23	0	254	254	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	COFFEE 'C' FUTURE SEP23	0	163	163	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	LME PRI ALUM FUTR SEP23	0	484	484	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	LME NICKEL FUTURE SEP23	0	110	110	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	LME LEAD FUTURE SEP23	0	116	116	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	LME ZINC FUTURE SEP23	0	258	258	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	COPPER FUTURE SEP23	0	183	183	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SILVER FUTURE SEP23	0	130	130	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	BRENT CRUDE FUTR NOV23	0	303	303	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SUGAR #11 (WORLD) OCT23	0	409	409	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/23	LEAN HOGS FUTURE OCT23	0	179	179	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/23	WTI CRUDE FUTURE NOV23	0	346	346	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/23	NATURAL GAS FUTR NOV23	0	771	771	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/23	NY HARB ULSD FUT NOV23	0	57	57	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/23	LIVE CATTLE FUTR OCT23	0	175	175	0 USD	0.00	0.00	0.00	
10/23	GASOLINE RBOB FUT NOV23	0	76	76	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	LOW SU GASOIL G NOV23	0	106	106	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	SOYBEAN FUTURE NOV23	0	266	266	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	LME PRI ALUM FUTR NOV23	0	472	472	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	LME NICKEL FUTURE NOV23	0	108	108	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	LME LEAD FUTURE NOV23	0	110	110	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	LME ZINC FUTURE NOV23	0	252	252	0 USD	0.00	0.00	0.00	
11/23	BRENT CRUDE FUTR JAN24	0	298	298	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	COTTON NO.2 FUTR DEC23	0	125	125	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SOYBEAN OIL FUTR DEC23	0	296	296	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	CORN FUTURE DEC23	0	558	558	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	KC HRW WHEAT FUT DEC23	0	140	140	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	LEAN HOGS FUTURE DEC23	0	174	174	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SOYBEAN MEAL FUTR DEC23	0	254	254	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	WHEAT FUTURE(CBT) DEC23	0	247	247	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	COFFEE 'C' FUTURE DEC23	0	161	161	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	WTI CRUDE FUTURE JAN24	0	264	264	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	GOLD 100 OZ FUTR DEC23	0	265	265	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	COPPER FUTURE DEC23	0	177	177	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NATURAL GAS FUTR JAN24	0	589	589	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SILVER FUTURE DEC23	0	127	127	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NY HARB ULSD FUT JAN24	0	43	43	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	LIVE CATTLE FUTR DEC23	0	171	171	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	GASOLINE RBOB FUT JAN24	0	57	57	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	LOW SU GASOIL G JAN24	0	83	83	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	SOYBEAN OIL FUTR JAN24	0	217	217	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	SOYBEAN FUTURE JAN24	0	197	197	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	SOYBEAN MEAL FUTR JAN24	0	186	186	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	LME PRI ALUM FUTR JAN24	0	360	360	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	LME NICKEL FUTURE JAN24	0	82	82	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	LME LEAD FUTURE JAN24	0	84	84	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	LME ZINC FUTURE JAN24	0	194	194	0 USD	0.00	0.00	0.00	
01/24	BRENT CRUDE FUTR MAR24	0	247	247	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	LEAN HOGS FUTURE FEB24	0	146	146	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	WTI CRUDE FUTURE MAR24	0	283	283	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	GOLD 100 OZ FUTR FEB24	0	213	213	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	NATURAL GAS FUTR MAR24	0	762	762	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
02/24	NY HARB ULSD FUT MAR24	0	50	50	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	LIVE CATTLE FUTR FEB24	0	142	142	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	SUGAR #11 (WORLD) MAR24	0	436	436	0 USD	0.00	0.00	0.00	
02/24	GASOLINE RBOB FUT MAR24	0	63	63	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	COTTON NO.2 FUTR MAR24	0	100	100	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	LOW SU GASOIL G MAR24	0	93	93	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SOYBEAN OIL FUTR MAR24	0	293	293	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	CORN FUTURE MAR24	0	620	620	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	KC HRW WHEAT FUT MAR24	0	146	146	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SOYBEAN FUTURE MAR24	0	235	235	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SOYBEAN MEAL FUTR MAR24	0	240	240	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	WHEAT FUTURE(CBT) MAR24	0	231	231	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	COFFEE 'C' FUTURE MAR24	0	132	132	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	LME PRI ALUM FUTR MAR24	0	193	193	0 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	LME NICKEL FUTURE MAR24	0	66	66	0 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	LME LEAD FUTURE MAR24	0	49	49	0 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	LME ZINC FUTURE MAR24	0	104	104	0 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	COPPER FUTURE MAR24	0	146	146	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SILVER FUTURE MAR24	0	104	104	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	BRENT CRUDE FUTR MAY24	0	246	13	233 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	LEAN HOGS FUTURE APR24	0	162	9	153 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	WTI CRUDE FUTURE MAY24	0	247	7	240 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	GOLD 100 OZ FUTR APR24	0	177	9	168 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	NATURAL GAS FUTR MAY24	0	755	23	732 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	NY HARB ULSD FUT MAY24	0	49	1	48 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	LIVE CATTLE FUTR APR24	0	128	6	122 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	SUGAR #11 (WORLD) MAY24	0	294	9	285 USD	0.00	0.00	0.00	a)
04/24	GASOLINE RBOB FUT MAY24	0	61	2	59 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	COTTON NO.2 FUTR MAY24	0	97	3	94 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	LOW SU GASOIL G MAY24	0	92	3	89 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	SOYBEAN OIL FUTR MAY24	0	290	8	282 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	CORN FUTURE MAY24	0	609	18	591 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	KC HRW WHEAT FUT MAY24	0	143	4	139 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	SOYBEAN FUTURE MAY24	0	233	7	226 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	SOYBEAN MEAL FUTR MAY24	0	237	7	230 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	WHEAT FUTURE(CBT) MAY24	0	227	7	220 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	LME PRI ALUM FUTR MAY24	0	180	5	175 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	LME NICKEL FUTURE MAY24	0	65	2	63 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	LME LEAD FUTURE MAY24	0	41	1	40 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	LME ZINC FUTURE MAY24	0	96	2	94 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	COFFEE 'C' FUTURE MAY24	0	107	3	104 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	COPPER FUTURE MAY24	0	138	4	134 USD	0.00	0.00	0.00	a)
05/24	SILVER FUTURE MAY24	0	95	3	92 USD	0.00	0.00	0.00	a)

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF	Verfall	04.04.2023	284'662'669	304'810'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.04.2023	561'639	600'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.04.2023	305'410'000	279'028'684	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2023	285'089'255	313'030'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.05.2023	660'000	600'657	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2023	243'711	270'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.05.2023	312'640'000	278'243'347	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.06.2023	278'072'892	313'530'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.06.2023	4'974'152	5'580'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	02.06.2023	32'360'000	28'973'817	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.06.2023	1'951'568	2'170'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	02.06.2023	288'920'000	264'136'442	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.07.2023	257'470'000	230'327'513	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	05.07.2023	243'697'165	267'600'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	05.07.2023	3'420'000	3'097'860	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	05.07.2023	2'960'000	2'657'050	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	05.07.2023	3'750'000	3'363'551	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.08.2023	240'874'616	270'060'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.08.2023	2'948'880	3'300'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.08.2023	273'360'000	236'951'182	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.09.2023	295'830'000	261'303'681	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	05.09.2023	255'181'278	295'440'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	05.09.2023	341'062	390'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.10.2023	252'611'985	286'870'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.10.2023	18'830'000	16'865'146	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.10.2023	34'100'000	31'249'479	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.10.2023	233'940'000	214'020'009	USD/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.	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		203'721'811	223'400'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		2'370'000	2'171'894		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		221'030'000	201'137'300		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		201'924'625	222'650'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		222'650'000	193'596'402		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		197'414'030	227'860'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		938'985	1'080'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		2'639'595	3'020'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		231'960'000	195'219'856		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		199'440'592	237'710'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		2'010'000	1'708'707		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		1'901'851	2'250'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		237'950'000	204'134'926		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		201'894'505	236'140'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		630'000	541'194		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		2'005'380	2'310'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		237'820'000	209'421'914		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		201'999'632	230'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)	
Devisentermingeschäfte auf Klassen								0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	9'721'877.72	4.63
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	200'067'355.11	95.30
Sonstige Vermögenswerte	138'034.99	0.07
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	209'927'267.82	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-5'761.74	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	209'921'506.08	

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);	200'067'355.11	95.30
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a) verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten	Kurswert CHF	in % 7)
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	113'366'205.81	54.00
US912797FH58 0.0000 % B 05/16/24	12'000 USD 98.91%	10'451'546.61 4.98
US912797GB79 0.0000 % B 07/11/24	10'000 USD 98.17%	8'644'199.48 4.12
US912797GK78 0.0000 % B 08/08/24	9'000 USD 97.80%	7'750'434.20 3.69
US912797GL51 0.0000 % B 09/05/24	10'000 USD 97.47%	8'582'571.23 4.09
US912797GX99 0.0000 % B 03/14/24	6'000 USD 99.80%	5'272'658.52 2.51
US912797GZ48 0.0000 % B 04/04/24	4'150 USD 99.50%	3'635'915.42 1.73
US912797HF74 0.0000 % B 04/11/24	13'000 USD 99.40%	11'378'193.02 5.42
US912797HG57 0.0000 % B 04/25/24	13'000 USD 99.20%	11'355'413.16 5.41
US912797HH31 0.0000 % B 05/02/24	17'000 USD 99.10%	14'834'842.36 7.07
US912797HQ30 0.0000 % B 05/09/24	8'000 USD 99.01%	6'974'535.53 3.32
US912797HS95 0.0000 % B 05/30/24	11'000 USD 98.72%	9'561'801.76 4.55
US912797LL96 0.0000 % B 03/21/24	17'000 USD 99.70%	14'924'094.52 7.11

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

USD	1 = CHF	0.88055000
-----	---------	------------

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	14'147'499.45	11.661
Bond	CHF	107'131'461.15	88.299
Equity	CHF	49'307.29	0.041
Total	CHF	121'328'267.89	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	232'372'249.07	110.695
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	226'458'006.45	107.877

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.035	0.00 - 0.05	-	0.013
NT USD	CHF	0.00 - 0.05	-	0.035	0.00 - 0.05	-	0.013
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.035	0.00 - 0.05	-	0.013
STH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.035	0.00 - 0.05	-	0.013

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	113'366'205.81
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FAH1 CHF	0.400	0.800	0.300	0.100	3.000
NT USD	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000
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.

9 Benchmark

Bloomberg Commodity Index TR

10 TER

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

11 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

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

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT USD	Ja	CHF	-	-	-
NTH1 CHF	Ja	CHF	-	-	-
STH1 CHF	Ja	CHF	-	-	-

13 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmäßig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

mit den Teilvermögen

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

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

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Begründung für die Vereinigung

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigung

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

7 Kosten

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

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

II Änderungen im Fondsvertrag

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

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

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

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

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

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

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

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgebliche investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anlegerinnen und Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

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

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

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

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

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

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

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

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

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

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

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

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

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

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

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

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

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

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

* * *

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

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

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

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index 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