

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND EMERGING MARKETS HARD CURRENCY

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
DTH1 CHF	39897025	CHF
GTH1 CHF	39897026	CHF
NT USD	120482891	USD
NTH1 CHF	39897027	CHF
STH1 CHF	39897028	CHF

Rechnungswährung: USD

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	26
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	27
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	27
7	Pauschale Verwaltungskommission	28
8	Benchmark	28
9	TER	28
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	29
11	Fussnoten	29
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	30
13	Pflichtpublikationen	32

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	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		429'833'457.34	293'148'918.82	368'679'715.62	315'009'343.21
Klasse DTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)				84'320.63	95'155.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode				850.000	850.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)				91.0117	101.3463
Thesaurierung je Anteil (in USD)				4.94	4.70
Total Expense Ratio (TER)				0.29 %	0.29 %
Klasse GTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		43'184'782.99	365'483.56	373'827.00	144'513.01
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		470'030.683	4'355.000	3'765.000	1'290.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.9019	78.6566	91.0936	101.4168
Thesaurierung je Anteil (in USD)		4.73	4.36	4.97	4.73
Total Expense Ratio (TER)		0.25 %	0.26 %	0.26 %	0.26 %
Klasse NT USD	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		20'323'873.57	18'448'974.35		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		184'586.374	182'240.878		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.1050	101.2340		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		96.9529	94.8816		
Thesaurierung je Anteil		5.84	3.12		
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %		
Klasse NTH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		340'436'207.64	253'176'355.58	347'460'101.61	297'033'010.50
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'664'458.697	2'988'746.283	3'471'773.967	2'635'169.797
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.8050	79.3943	91.8197	102.0443
Thesaurierung je Anteil (in USD)		5.01	4.62	5.30	5.04
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse STH1 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		25'888'593.14	21'158'105.33	20'761'466.38	17'736'664.14
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		278.706	249.789	207.460	157.364
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81'793.0030	79'388.7410	91'813.3969	102'037.3278
Thesaurierung je Anteil (in USD)		5'016.67	4'621.66	5'303.41	5'043.28
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DTH1 CHF (Schliessung 07.07.2022)	-	-	-20.74 %	-3.38 %
Klasse GTH1 CHF	4.65 %	5.57 %	-20.19 %	-3.35 %
Klasse NT USD (Lancierung 28.07.2022)	9.92 %	10.97 %	0.33 %	-
Klasse NTH1 CHF	4.92 %	5.86 %	-19.99 %	-3.10 %
Klasse STH1 CHF	4.92 %	5.85 %	-19.99 %	-3.10 %
Benchmark Hedge	5.15 %	6.13 %	-20.33 %	-
Benchmark	10.05 %	11.09 %	-17.78 %	-3.04 %
Tracking Error 33)	0.17 %	0.17 %	0.52 %	0.09 %

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 GTH1 CHF	-0.50 %
Klasse NT USD (Lancierung 28.07.2022)	-0.13 %
Klasse NTH1 CHF	-0.23 %
Klasse STH1 CHF	-0.23 %

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	2'735'026.42	2'548'379.03
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	421'329'934.76	286'648'076.24
Sonstige Vermögenswerte	5'892'768.83	3'952'538.19
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	429'957'730.01	293'148'993.46
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-116'040.97	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-8'231.70	-74.64
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	429'833'457.34	293'148'918.82

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse DTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		-	850.000
Zurückgenommene Anteile		-	-850.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	-
Klasse GTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'355.000	3'765.000
Ausgegebene Anteile		471'803.225	590.000
Zurückgenommene Anteile		-6'127.542	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		470'030.683	4'355.000
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		182'240.878	-
Ausgegebene Anteile		41'716.496	201'584.878
Zurückgenommene Anteile		-39'371.000	-19'344.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		184'586.374	182'240.878
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'988'746.283	3'471'773.967
Ausgegebene Anteile		1'130'608.678	691'726.114
Zurückgenommene Anteile		-454'896.264	-1'174'753.798
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'664'458.697	2'988'746.283
Klasse STH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		249.789	207.460
Ausgegebene Anteile		30.875	44.063
Zurückgenommene Anteile		-1.958	-1.734
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		278.706	249.789

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		293'148'918.82	368'679'715.62
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-6'330'299.21	-6'830'628.24
Saldo aus dem Anteilverkehr		103'821'031.27	-17'532'934.40
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		39'193'806.46	-51'167'234.16
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		429'833'457.34	293'148'918.82

Erfolgsrechnung

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		127'186.71	27'140.80
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-3'504.00
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		20'657'917.98	17'166'200.27
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		3'800'369.83	1'549'937.25
Total Ertrag		24'585'474.52	18'739'774.32
Aufwand			
Passivzinsen		-13.59	-71.29
Reglementarische Vergütungen		-16'910.99	-950.26
Sonstige Aufwendungen		-89.74	-103.81
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'477'320.77	-3'181'539.41
Total Aufwand		-1'494'335.09	-3'182'664.77
Nettoertrag / Verlust		23'091'139.43	15'557'109.55
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'423'204.90	-36'171'131.26
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		804'768.88	439'851.13
Realisierter Erfolg		18'472'703.41	-20'174'170.58
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		20'721'103.05	-30'993'063.58
Gesamterfolg		39'193'806.46	-51'167'234.16

Verwendung des Erfolges

	29.02.2024	28.02.2023
Klasse GTH1 CHF		
Nettoertrag	2'227'382.28	19'004.64
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'227'382.28	19'004.64
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	779'583.80	6'651.62
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'447'798.48	12'353.02
Total	2'227'382.28	19'004.64
Klasse NT USD		
Nettoertrag	1'079'797.92	569'762.19
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'079'797.92	569'762.19
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	377'929.27	199'416.77
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	701'868.65	370'345.42
Total	1'079'797.92	569'762.19
Klasse NTH1 CHF		
Nettoertrag	18'385'782.34	13'813'902.72
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	18'385'782.34	13'813'902.72
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	6'435'023.82	4'834'865.95
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	11'950'758.52	8'979'036.77
Total	18'385'782.34	13'813'902.72
Klasse STH1 CHF		
Nettoertrag	1'398'176.89	1'154'440.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'398'176.89	1'154'440.00
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	489'361.91	404'054.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	908'814.98	750'386.00
Total	1'398'176.89	1'154'440.00

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 USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							417'884'118.70	97.19	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							417'884'118.70	97.19	
US040114HS26	0.7500 % ARGENT 0 3/4 07/09/30	3'285	2'220	1'150	4'355 USD	46.12%	2'008'507.09	0.47	a)
US040114HT09	3.6250 % ARGENT 3 5/8 07/09/35	3'977	2'650	1'000	5'627 USD	37.13%	2'088'962.87	0.49	a)
US040114HU71	4.2500 % ARGENT 4 1/4 01/09/38	2'390	1'430	550	3'270 USD	41.75%	1'365'225.00	0.32	a)
US040114HV54	3.5000 % ARGENT 3 1/2 07/09/41	2'100	800	0	2'900 USD	35.80%	1'038'200.00	0.24	a)
US040114HW38	3.6250 % ARGENT 3 5/8 07/09/46	320	200	0	520 USD	38.84%	201'987.50	0.05	a)
US040114HX11	1.0000 % ARGENT 1 07/09/29	474	200	0	674 USD	46.31%	312'113.37	0.07	a)
US05968AAG13	2.7040 % BANCO 2.704 01/09/25 REGS	200	0	0	200 USD	97.46%	194'922.00	0.05	a)
US105756AE07	10.1250 % BRAZIL 10 1/8 05/15/27	200	320	100	420 USD	114.44%	480'648.00	0.11	a)
US105756AR10	8.8750 % BRAZIL 8 7/8 04/15/24	300	100	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US105756BB58	8.2500 % BRAZIL 8 1/4 01/20/34	400	250	150	500 USD	114.63%	573'125.00	0.13	a)
US105756BF62	8.7500 % BRAZIL 8 3/4 02/04/25	200	300	150	350 USD	102.72%	359'515.63	0.08	a)
US105756BK57	7.1250 % BRAZIL 7 1/8 01/20/37	450	300	0	750 USD	106.69%	800'145.00	0.19	a)
US105756BR01	5.6250 % BRAZIL 5 5/8 01/07/41	600	200	0	800 USD	89.82%	718'576.00	0.17	a)
US105756BV13	4.2500 % BRAZIL 4 1/4 01/07/25	1'200	650	250	1'600 USD	98.78%	1'580'500.00	0.37	a)
US105756BW95	5.0000 % BRAZIL 5 01/27/45	1'000	400	200	1'200 USD	79.69%	956'304.00	0.22	a)
US105756BX78	6.0000 % BRAZIL 6 04/07/26	600	400	200	800 USD	101.54%	812'312.00	0.19	a)
US105756BY51	5.6250 % BRAZIL 5 5/8 02/21/47	800	220	0	1'020 USD	85.15%	868'550.40	0.20	a)
US105756BZ27	4.6250 % BRAZIL 4 5/8 01/13/28	800	400	0	1'200 USD	97.91%	1'174'884.00	0.27	a)
US105756CA66	4.5000 % BRAZIL 4 1/2 05/30/29	600	400	200	800 USD	94.55%	756'400.00	0.18	a)
US105756CB40	4.7500 % BRAZIL 4 3/4 01/14/50	1'200	450	0	1'650 USD	73.94%	1'220'059.50	0.28	a)
US105756CC23	3.8750 % BRAZIL 3 7/8 06/12/30	1'050	400	0	1'450 USD	89.60%	1'299'142.00	0.30	a)
US105756CD06	2.8750 % BRAZIL 2 7/8 06/06/25	600	0	0	600 USD	96.52%	579'090.00	0.13	a)
US105756CE88	3.7500 % BRAZIL 3 3/4 09/12/31	400	200	0	600 USD	86.90%	521'394.00	0.12	a)
US105756CF53	6.0000 % BRAZIL 6 10/20/33	0	900	0	900 USD	99.13%	892'197.00	0.21	a)
US105756CG37	6.2500 % BRAZIL 6 1/4 03/18/31	0	660	0	660 USD	101.44%	669'477.60	0.16	a)
US168863CA49	3.1250 % CHILE 3 1/8 01/21/26	200	0	0	200 USD	96.66%	193'310.00	0.04	a)
US168863CE60	3.8600 % CHILE 3.86 06/21/47	400	600	600	400 USD	78.37%	313'472.00	0.07	a)
US168863CF36	3.2400 % CHILE 3.24 02/06/28	600	200	200	600 USD	93.55%	561'270.00	0.13	a)
US168863DL94	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/25/50	450	500	200	750 USD	72.46%	543'442.50	0.13	a)
US168863DN50	2.5500 % CHILE 2.55 01/27/32	400	200	200	400 USD	84.19%	336'776.00	0.08	a)
US168863DP09	2.4500 % CHILE 2.45 01/31/31	400	200	200	400 USD	85.07%	340'260.00	0.08	a)
US168863DQ81	3.1000 % CHILE 3.1 01/22/61	550	0	0	550 USD	62.71%	344'894.00	0.08	a)
US168863DS48	3.1000 % CHILE 3.1 05/07/41	800	0	0	800 USD	73.35%	586'832.00	0.14	a)
US168863DT21	2.5500 % CHILE 2.55 07/27/33	600	0	0	600 USD	80.92%	485'508.00	0.11	a)
US168863DU93	3.2500 % CHILE 3 1/4 09/21/2071	200	200	0	400 USD	62.70%	250'816.00	0.06	a)
US168863DV76	3.5000 % CHILE 3 1/2 01/31/34	350	250	0	600 USD	87.07%	522'444.00	0.12	a)
US168863DW59	4.0000 % CHILE 4 01/31/52	200	200	0	400 USD	78.53%	314'136.00	0.07	a)
US168863DX33	2.7500 % CHILE 2 3/4 01/31/27	250	200	0	450 USD	93.71%	421'704.00	0.10	a)
US168863DY16	4.3400 % CHILE 4.34 03/07/42	400	200	0	600 USD	86.57%	519'396.00	0.12	a)
US168863DZ80	4.9500 % CHILE 4.95 01/05/36	0	600	0	600 USD	96.80%	580'776.00	0.14	a)
US168863EA21	5.3300 % CHILE 5.33 01/05/54	0	533	0	533 USD	95.56%	508'987.24	0.12	a)
US168863EB04	4.8500 % CHILE 4.85 01/22/29	0	550	0	550 USD	99.21%	545'677.00	0.13	a)
US195325BD67	8.1250 % COLOM 8 1/8 05/21/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US195325BK01	7.3750 % COLOM 7 3/8 09/18/37	500	300	0	800 USD	98.15%	785'168.00	0.18	a)
US195325BM66	6.1250 % COLOM 6 1/8 01/18/41	800	600	350	1'050 USD	85.19%	894'526.50	0.21	a)
US195325BQ70	4.0000 % COLOM 4 02/26/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US195325BR53	5.6250 % COLOM 5 5/8 02/26/44	800	400	200	1'000 USD	78.35%	783'530.00	0.18	a)
US195325CU73	5.0000 % COLOM 5 06/15/45	1'450	600	250	1'800 USD	71.87%	1'293'570.00	0.30	a)
US195325CX13	4.5000 % COLOM 4 1/2 01/28/26	600	0	0	600 USD	97.44%	584'634.00	0.14	a)
US195325DL65	3.8750 % COLOM 3 7/8 04/25/27	600	200	0	800 USD	93.88%	751'000.00	0.17	a)
US195325DP79	4.5000 % COLOM 4 1/2 03/15/29	600	200	0	800 USD	91.25%	730'008.00	0.17	a)
US195325DQ52	5.2000 % COLOM 5.2 05/15/49	1'000	200	0	1'200 USD	72.62%	871'428.00	0.20	a)
US195325DR36	3.0000 % COLOM 3 01/30/30	600	200	0	800 USD	82.04%	656'336.00	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US195325DS19	3.1250 % COLOM 3 1/8 04/15/31	800	200	0	1'000 USD	79.15%	791'450.00	0.18	a)
US195325DT91	4.1250 % COLOM 4 1/8 05/15/51	470	200	0	670 USD	61.31%	410'797.10	0.10	a)
US195325DX04	3.8750 % COLOM 3 7/8 02/15/61	500	0	0	500 USD	57.21%	286'035.00	0.07	a)
US195325DZ51	3.2500 % COLOM 3 1/4 04/22/32	600	400	200	800 USD	77.20%	617'568.00	0.14	a)
US195325EA91	4.1250 % COLOM 4 1/8 02/22/42	250	200	0	450 USD	66.70%	300'127.50	0.07	a)
US195325EF88	8.0000 % COLOM 8 04/20/33	350	250	0	600 USD	104.68%	628'065.00	0.15	a)
US195325EG61	7.5000 % COLOM 7 1/2 02/02/34	0	1'150	200	950 USD	101.16%	961'029.50	0.22	a)
US195325EL56	8.0000 % COLOM 8 11/14/35	0	450	0	450 USD	103.97%	467'865.00	0.11	a)
US195325EM30	8.7500 % COLOM 8 3/4 11/14/53	0	450	0	450 USD	107.08%	481'846.50	0.11	a)
US445545AF36	7.6250 % REPHUN 7 5/8 03/29/41	800	450	200	1'050 USD	114.35%	1'200'696.00	0.28	a)
US445545AJ57	5.7500 % REPHUN 5 3/4 11/22/23	92	0	92	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US445545AL04	5.3750 % REPHUN 5 3/8 03/25/24	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US455780CD62	3.5000 % INDON 3 1/2 01/11/28	200	0	0	200 USD	94.91%	189'818.00	0.04	a)
US455780CE46	4.3500 % INDON 4.35 01/11/48	200	200	0	400 USD	86.41%	345'625.00	0.08	a)
US455780CF11	4.1000 % INDON 4.1 04/24/28	200	0	0	200 USD	96.53%	193'064.00	0.04	a)
US455780CH76	4.7500 % INDON 4 3/4 02/11/29	200	0	0	200 USD	98.87%	197'744.00	0.05	a)
US455780CJ33	5.3500 % INDON 5.35 02/11/49	200	0	0	200 USD	99.79%	199'586.00	0.05	a)
US455780CK06	3.4000 % INDON 3.4 09/18/29	0	200	0	200 USD	92.32%	184'642.00	0.04	a)
US455780CN45	3.7000 % INDON 3.7 10/30/49	200	0	0	200 USD	77.13%	154'250.00	0.04	a)
US455780CQ75	2.8500 % INDON 2.85 02/14/30	200	200	0	400 USD	88.70%	354'808.00	0.08	a)
US455780CR58	3.5000 % INDON 3 1/2 02/14/50	200	0	0	200 USD	73.82%	147'644.00	0.03	a)
US455780CS32	3.8500 % INDON 3.85 10/15/30	300	0	0	300 USD	93.15%	279'444.00	0.06	a)
US455780CT15	4.2000 % INDON 4.2 10/15/50	200	200	0	400 USD	83.16%	332'650.00	0.08	a)
US455780CU87	4.4500 % INDON 4.45 04/15/70	200	0	0	200 USD	83.16%	166'325.00	0.04	a)
US455780CV60	1.8500 % INDON 1.85 03/12/31	200	0	0	200 USD	81.22%	162'438.00	0.04	a)
US455780CW44	3.0500 % INDON 3.05 03/12/51	200	400	200	400 USD	70.02%	280'080.00	0.07	a)
US455780CX27	3.3500 % INDON 3.35 03/12/2071	200	0	0	200 USD	65.48%	130'956.00	0.03	a)
US455780CY00	2.1500 % INDON 2.15 07/28/31	200	0	0	200 USD	81.90%	163'790.00	0.04	a)
US455780DG84	3.2000 % INDON 3.2 09/23/61	200	0	0	200 USD	65.25%	130'500.00	0.03	a)
US455780DJ24	3.5500 % INDON 3.55 03/31/32	200	0	0	200 USD	89.70%	179'392.00	0.04	a)
US455780DK96	4.3000 % INDON 4.3 03/31/52	200	0	0	200 USD	84.59%	169'187.50	0.04	a)
US455780DM52	4.1500 % INDON 4.15 09/20/27	0	200	0	200 USD	97.22%	194'432.00	0.05	a)
US455780DN36	4.6500 % INDON 4.65 09/20/32	200	0	0	200 USD	96.65%	193'302.00	0.04	a)
US455780DP83	5.4500 % INDON 5.45 09/20/52	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US455780DQ66	4.5500 % INDON 4.55 01/11/28	0	200	0	200 USD	98.22%	196'434.00	0.05	a)
US455780DR40	4.8500 % INDON 4.85 01/11/33	0	300	0	300 USD	98.16%	294'474.00	0.07	a)
US455780DS23	5.6500 % INDON 5.65 01/11/53	0	200	0	200 USD	103.09%	206'170.00	0.05	a)
US455780DT06	4.4000 % INDON 4.4 03/10/29	0	200	0	200 USD	97.33%	194'650.00	0.05	a)
US455780DU78	4.7000 % INDON 4.7 02/10/34	0	200	0	200 USD	97.38%	194'750.00	0.05	a)
US455780DV51	5.1000 % INDON 5.1 02/10/54	0	200	0	200 USD	96.09%	192'187.50	0.04	a)
US470160AV46	8.0000 % JAMAN 8 03/15/39	500	500	150	850 USD	117.43%	998'112.50	0.23	a)
US470160CA80	6.7500 % JAMAN 6 3/4 04/28/28	800	0	0	800 USD	102.99%	823'880.00	0.19	a)
US470160CB63	7.8750 % JAMAN 7 7/8 07/28/45	1'000	200	0	1'200 USD	115.80%	1'389'636.00	0.32	a)
US67778NAA63	7.5000 % OILGAS 7 1/2 10/25/27 REGS	400	200	0	600 USD	103.34%	620'062.50	0.14	a)
US69370RAA59	6.4500 % PERTU 6.45 05/30/44 REGS	200	0	0	200 USD	104.22%	208'437.50	0.05	a)
US69370RAC16	6.5000 % PERTU 6 1/2 11/07/48 REGS	0	200	0	200 USD	105.17%	210'342.00	0.05	a)
US69370RAD98	3.6500 % PERTU 3.65 07/30/29 REGS	0	200	0	200 USD	92.63%	185'266.00	0.04	a)
US69370RAE71	4.7000 % PERTU 4.7 07/30/49 REGS	200	0	0	200 USD	83.89%	167'770.00	0.04	a)
US69370RAF47	3.1000 % PERTU 3.1 01/21/30 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US69370RAG20	4.1750 % PERTU 4.175 01/21/50 REGS	200	0	0	200 USD	76.88%	153'750.00	0.04	a)
US69370RAH03	3.1000 % PERTU 3.1 08/27/30 REGS	0	200	0	200 USD	88.06%	176'125.00	0.04	a)
US69370RAJ68	4.1500 % PERTU 4.15 02/25/60 REGS	200	0	0	200 USD	74.38%	148'750.00	0.03	a)
US69370RAK32	1.4000 % PERTU 1.4 02/09/26 REGS	200	0	0	200 USD	92.53%	185'058.00	0.04	a)
US69370RAL15	2.3000 % PERTU 2.3 02/09/31 REGS	200	0	0	200 USD	82.32%	164'640.00	0.04	a)
US698299AD63	8.8750 % PANAMA 8 7/8 09/30/27	300	300	250	350 USD	107.82%	377'377.00	0.09	a)
US698299AK07	9.3750 % PANAMA 9 3/8 04/01/29	300	100	0	400 USD	110.57%	442'276.00	0.10	a)
US698299AV61	7.1250 % PANAMA 7 1/8 01/29/26	400	0	0	400 USD	101.66%	406'640.00	0.09	a)
US698299AW45	6.7000 % PANAMA 6.7 01/26/36	650	450	200	900 USD	94.30%	848'655.00	0.20	a)
US698299BB98	4.3000 % PANAMA 4.3 04/29/53	600	450	250	800 USD	62.84%	502'750.00	0.12	a)
US698299BE38	3.7500 % PANAMA 3 3/4 03/16/25	400	200	0	600 USD	97.59%	585'562.50	0.14	a)
US698299BF03	3.8750 % PANAMA 3 7/8 03/17/28	400	400	200	600 USD	90.69%	544'125.00	0.13	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 USD	in % 7)	Kat.
US698299BG85	4.5000 % PANAMA 4 1/2 05/15/47	400	200	0	600 USD	66.75%	400'500.00	0.09	a)
US698299BH68	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/16/50	800	400	200	1'000 USD	65.06%	650'625.00	0.15	a)
US698299BK97	3.1600 % PANAMA 3.16 01/23/30	400	200	0	600 USD	82.21%	493'236.00	0.11	a)
US698299BL70	3.8700 % PANAMA 3.87 07/23/60	1'000	500	200	1'300 USD	55.94%	727'187.50	0.17	a)
US698299BM53	4.5000 % PANAMA 4 1/2 04/01/56	800	200	0	1'000 USD	63.28%	632'750.00	0.15	a)
US698299BN37	2.2520 % PANAMA 2.252 09/29/32	800	400	0	1'200 USD	70.16%	841'875.00	0.20	a)
US698299BR41	3.2980 % PANAMA 3.298 01/19/33	400	0	0	400 USD	75.63%	302'500.00	0.07	a)
US698299BS24	4.5000 % PANAMA 4 1/2 01/19/63	600	0	0	600 USD	62.13%	372'750.00	0.09	a)
US698299BT07	6.4000 % PANAMA 6.4 02/14/35	450	600	0	1'050 USD	92.38%	969'937.50	0.23	a)
US698299BV52	6.8530 % PANAMA 6.853 03/28/54	0	700	0	700 USD	88.13%	616'875.00	0.14	a)
US698299BW36	6.8750 % PANAMA 6 7/8 01/31/36	0	400	0	400 USD	94.45%	377'800.00	0.09	a)
US706451BG56	6.6250 % PEMEX 6 5/8 06/15/35	400	100	0	500 USD	73.99%	369'930.00	0.09	a)
US715638AP79	8.7500 % PERU 8 3/4 11/21/33	700	500	100	1'100 USD	122.74%	1'350'085.00	0.31	a)
US715638AS19	7.3500 % PERU 7.35 07/21/25	500	150	200	450 USD	102.56%	461'524.50	0.11	a)
US715638AU64	6.5500 % PERU 6.55 03/14/37	400	200	0	600 USD	107.86%	647'160.00	0.15	a)
US715638BM30	5.6250 % PERU 5 5/8 11/18/50	900	690	200	1'390 USD	98.93%	1'375'168.70	0.32	a)
US715638BU55	4.1250 % PERU 4 1/8 08/25/27	400	0	0	400 USD	96.83%	387'320.00	0.09	a)
US715638DA73	2.8440 % PERU 2.844 06/20/30	300	400	300	400 USD	87.31%	349'220.00	0.08	a)
US715638DE95	2.3920 % PERU 2.392 01/23/26	400	200	200	400 USD	94.77%	379'064.00	0.09	a)
US715638DF60	2.7830 % PERU 2.783 01/23/31	1'170	600	0	1'770 USD	85.09%	1'506'057.60	0.35	a)
US715638DP43	1.8620 % PERU 1.862 12/01/32	350	150	0	500 USD	75.57%	377'825.00	0.09	a)
US715638DQ26	2.7800 % PERU 2.78 12/01/60	700	550	150	1'100 USD	57.35%	630'839.00	0.15	a)
US715638DR09	3.2300 % PERU 3.23 07/28/2121	350	100	0	450 USD	57.10%	256'959.00	0.06	a)
US715638DS81	3.3000 % PERU 3.3 03/11/41	500	180	100	580 USD	74.24%	430'603.60	0.10	a)
US715638DT64	3.5500 % PERU 3.55 03/10/51	670	200	0	870 USD	71.79%	624'590.40	0.15	a)
US715638DU38	3.0000 % PERU 3 01/15/34	800	460	0	1'260 USD	81.44%	1'026'106.20	0.24	a)
US715638DW93	3.6000 % PERU 3.6 01/15/2072	400	100	0	500 USD	65.56%	327'780.00	0.08	a)
US71567RAC07	4.3500 % INDOIS 4.35 09/10/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US71567RAD89	4.3250 % INDOIS 4.325 05/28/25 REGS	400	0	0	400 USD	99.31%	397'256.00	0.09	a)
US71567RAF38	4.5500 % INDOIS 4.55 03/29/26 REGS	200	200	0	400 USD	98.93%	395'720.00	0.09	a)
US71567RAH93	4.1500 % INDOIS 4.15 03/29/27 REGS	400	0	0	400 USD	97.64%	390'540.00	0.09	a)
US71567RAK23	4.4000 % INDOIS 4.4 03/01/28 REGS	200	200	0	400 USD	98.08%	392'328.00	0.09	a)
US71567RAL06	3.9000 % INDOIS 3.9 08/20/24 REGS	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US71567RAM88	4.4500 % INDOIS 4.45 02/20/29 REGS	200	0	0	200 USD	97.51%	195'020.00	0.05	a)
US71567RAN61	2.3000 % INDOIS 2.3 06/23/25 REGS	0	200	0	200 USD	96.45%	192'890.00	0.04	a)
US71567RAP10	2.8000 % INDOIS 2.8 06/23/30 REGS	200	0	0	200 USD	88.20%	176'400.00	0.04	a)
US71567RAQ92	3.8000 % INDOIS 3.8 06/23/50 REGS	200	0	0	200 USD	76.26%	152'522.00	0.04	a)
US71567RAR75	1.5000 % INDOIS 1 1/2 06/09/26 REGS	200	0	0	200 USD	92.49%	184'972.00	0.04	a)
US71567RAS58	2.5500 % INDOIS 2.55 06/09/31 REGS	200	0	0	200 USD	85.03%	170'056.00	0.04	a)
US71567RAT32	3.5500 % INDOIS 3.55 06/09/51 REGS	200	0	0	200 USD	73.35%	146'700.00	0.03	a)
US71567RAU05	4.4000 % INDOIS 4.4 06/06/27 REGS	200	200	0	400 USD	98.12%	392'492.00	0.09	a)
US71567RAV87	4.7000 % INDOIS 4.7 06/06/32 REGS	200	400	200	400 USD	97.99%	391'964.00	0.09	a)
US71567RAX44	5.4000 % INDOIS 5.4 11/15/28 REGS	0	200	0	200 USD	101.01%	202'020.00	0.05	a)
US71567RAY27	5.6000 % INDOIS 5.6 11/15/33 REGS	0	200	0	200 USD	103.79%	207'570.00	0.05	a)
US71568QAB32	5.2500 % PLNII 5 1/4 10/24/42 REGS	200	0	0	200 USD	90.07%	180'138.00	0.04	a)
US71568QAC15	4.1250 % PLNII 4 1/8 05/15/27 REGS	200	200	0	400 USD	96.10%	384'416.00	0.09	a)
US71568QAE70	5.4500 % PLNII 5.45 05/21/28 REGS	200	0	0	200 USD	99.59%	199'170.00	0.05	a)
US71568QAF46	6.1500 % PLNII 6.15 05/21/48 REGS	200	0	0	200 USD	97.27%	194'536.00	0.05	a)
US71568QAH02	6.2500 % PLNII 6 1/4 01/25/49 REGS	0	200	0	200 USD	98.51%	197'022.00	0.05	a)
US71568QAJ67	3.8750 % PLNII 3 7/8 07/17/29 REGS	200	200	200	200 USD	92.35%	184'708.00	0.04	a)
US71568QAK31	4.8750 % PLNII 4 7/8 07/17/49 REGS	200	0	0	200 USD	82.03%	164'062.50	0.04	a)
US71568QAL14	3.3750 % PLNII 3 3/8 02/05/30 REGS	200	0	0	200 USD	88.84%	177'676.00	0.04	a)
US71568QAM96	4.3750 % PLNII 4 3/8 02/05/50 REGS	0	200	0	200 USD	76.29%	152'574.00	0.04	a)
US71568QAP28	4.0000 % PLNII 4 06/30/50 REGS	200	0	0	200 USD	71.44%	142'888.00	0.03	a)
US71643VAB18	6.7000 % PEMEX 6.7 02/16/32	883	520	250	1'153 USD	80.67%	930'125.10	0.22	a)
US71654QAZ54	6.5000 % PEMEX 6 1/2 06/02/41	200	100	0	300 USD	66.00%	198'000.00	0.05	a)
US71654QBE17	5.5000 % PEMEX 5 1/2 06/27/44	100	0	0	100 USD	58.45%	58'454.00	0.01	a)
US71654QBR20	6.3750 % PEMEX 6 3/8 01/23/45	200	0	0	200 USD	62.13%	124'250.00	0.03	a)
US71654QBV32	4.2500 % PEMEX 4 1/4 01/15/25	200	0	100	100 USD	97.44%	97'436.00	0.02	a)
US71654QBW15	4.5000 % PEMEX 4 1/2 01/23/26	200	0	0	200 USD	93.10%	186'200.00	0.04	a)
US71654QBX97	5.6250 % PEMEX 5 5/8 01/23/46	0	160	0	160 USD	57.50%	92'000.00	0.02	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 USD	in % 7)	Kat.
US71654QCB68	6.8750 % PEMEX 6 7/8 08/04/26	400	0	0	400 USD	96.34%	385'360.00	0.09	a)
US71654QCC42	6.7500 % PEMEX 6 3/4 09/21/47	800	340	100	1'040 USD	63.50%	660'400.00	0.15	a)
US71654QCG55	6.5000 % PEMEX 6 1/2 03/13/27	550	140	0	690 USD	93.27%	643'528.50	0.15	a)
US71654QCK67	5.3500 % PEMEX 5.35 02/12/28	200	150	0	350 USD	86.83%	303'908.50	0.07	a)
US71654QCL41	6.3500 % PEMEX 6.35 02/12/48	220	140	0	360 USD	61.20%	220'320.00	0.05	a)
US71654QCP54	6.5000 % PEMEX 6 1/2 01/23/29	180	250	150	280 USD	87.60%	245'274.40	0.06	a)
US71654QDB59	6.4900 % PEMEX 6.49 01/23/27	200	100	0	300 USD	93.47%	280'407.00	0.07	a)
US71654QDC33	6.8400 % PEMEX 6.84 01/23/30	299	220	0	519 USD	85.48%	443'630.82	0.10	a)
US71654QDD16	7.6900 % PEMEX 7.69 01/23/50	1'191	240	0	1'431 USD	68.89%	985'744.35	0.23	a)
US71654QDE98	5.9500 % PEMEX 5.95 01/28/31	552	250	100	702 USD	77.64%	545'032.80	0.13	a)
US71654QDF63	6.9500 % PEMEX 6.95 01/28/60	605	100	0	705 USD	63.44%	447'252.00	0.10	a)
US71654QDH20	6.8750 % PEMEX 6 7/8 10/16/25	200	0	0	200 USD	98.54%	197'080.00	0.05	a)
US71654QDL32	8.7500 % PEMEX 8 3/4 06/02/29	300	0	0	300 USD	95.55%	286'650.00	0.07	a)
US71654QDP46	10.0000 % PEMEX 10 02/07/33	0	330	0	330 USD	96.89%	319'737.00	0.07	a)
US71656MAF68	6.6250 % PEMEX 6 5/8 PERP REGS	130	0	0	130 USD	58.42%	75'942.10	0.02	a)
US718286AP29	10.6250 % PHILIP 10 5/8 03/16/25	400	250	0	650 USD	105.64%	686'653.50	0.16	a)
US718286AY36	9.5000 % PHILIP 9 1/2 02/02/30	600	100	0	700 USD	122.39%	856'702.00	0.20	a)
US718286BB24	7.7500 % PHILIP 7 3/4 01/14/31	500	300	200	600 USD	115.29%	691'740.00	0.16	a)
US718286BD89	6.3750 % PHILIP 6 3/8 01/15/32	300	100	0	400 USD	108.15%	432'616.00	0.10	a)
US718286BG11	6.3750 % PHILIP 6 3/8 10/23/34	600	150	0	750 USD	109.77%	823'245.00	0.19	a)
US718286BN61	5.5000 % PHILIP 5 1/2 03/30/26	400	0	0	400 USD	101.13%	404'500.00	0.09	a)
US718286BW60	5.0000 % PHILIP 5 01/13/37	400	200	0	600 USD	98.49%	590'934.00	0.14	a)
US718286BY27	4.2000 % PHILIP 4.2 01/21/24	400	200	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US718286BZ91	3.9500 % PHILIP 3.95 01/20/40	600	400	200	800 USD	85.68%	685'424.00	0.16	a)
US718286CA32	3.7000 % PHILIP 3.7 03/01/41	600	200	0	800 USD	81.73%	653'840.00	0.15	a)
US718286CB15	3.7000 % PHILIP 3.7 02/02/42	600	0	0	600 USD	81.13%	486'750.00	0.11	a)
US718286CC97	3.0000 % PHILIP 3 02/01/28	600	400	200	800 USD	92.80%	742'424.00	0.17	a)
US718286CG02	3.7500 % PHILIP 3 3/4 01/14/29	400	400	200	600 USD	94.68%	568'080.00	0.13	a)
US718286CH84	2.9500 % PHILIP 2.95 05/05/45	400	450	200	650 USD	69.39%	451'022.00	0.10	a)
US718286CJ41	2.4570 % PHILIP 2.457 05/05/30	400	0	0	400 USD	86.20%	344'808.00	0.08	a)
US718286CK14	1.6480 % PHILIP 1.648 06/10/31	400	0	0	400 USD	79.32%	317'272.00	0.07	a)
US718286CL96	2.6500 % PHILIP 2.65 12/10/45	570	0	0	570 USD	65.46%	373'110.60	0.09	a)
US718286CN52	1.9500 % PHILIP 1.95 01/06/32	200	400	200	400 USD	80.01%	320'056.00	0.07	a)
US718286CP01	3.2000 % PHILIP 3.2 07/06/46	650	200	0	850 USD	71.54%	608'068.75	0.14	a)
US718286CQ83	3.2290 % PHILIP 3.229 03/29/27	200	0	0	200 USD	94.84%	189'678.00	0.04	a)
US718286CR66	3.5560 % PHILIP 3.556 09/29/32	200	200	0	400 USD	89.44%	357'768.00	0.08	a)
US718286CT23	5.6090 % PHILIP 5.609 04/13/33	200	400	400	200 USD	103.30%	206'606.00	0.05	a)
US718286CU95	5.9500 % PHILIP 5.95 10/13/47	250	0	0	250 USD	106.55%	266'380.00	0.06	a)
US718286CV78	5.1700 % PHILIP 5.17 10/13/27	200	0	0	200 USD	100.55%	201'108.00	0.05	a)
US718286CW51	5.0000 % PHILIP 5 07/17/33	0	470	0	470 USD	99.71%	468'627.60	0.11	a)
US718286CX35	5.5000 % PHILIP 5 1/2 01/17/48	0	620	0	620 USD	101.10%	626'820.00	0.15	a)
US718286CY18	4.6250 % PHILIP 4 5/8 07/17/28	0	200	0	200 USD	98.83%	197'662.00	0.05	a)
US731011AU68	3.2500 % POLAND 3 1/4 04/06/26	900	300	50	1'150 USD	97.24%	1'118'202.50	0.26	a)
US731011AV42	4.8750 % POLAND 4 7/8 10/04/33	0	1'800	170	1'630 USD	98.10%	1'598'948.50	0.37	a)
US731011AW25	5.5000 % POLAND 5 1/2 04/04/53	0	1'670	0	1'670 USD	99.92%	1'668'580.50	0.39	a)
US760942AS16	7.6250 % URUGUA 7 5/8 03/21/36	500	230	0	730 USD	120.06%	876'456.25	0.20	a)
US760942AY83	4.1250 % URUGUA 4 1/8 11/20/45	400	90	0	490 USD	87.01%	426'368.60	0.10	a)
US760942AZ58	4.5000 % URUGUA 4 1/2 08/14/24	450	150	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US760942BA98	5.1000 % URUGUA 5.1 06/18/50	1'980	850	300	2'530 USD	95.98%	2'428'167.50	0.56	a)
US760942BB71	4.3750 % URUGUA 4 3/8 10/27/27	750	180	0	930 USD	98.53%	916'282.50	0.21	a)
US760942BD38	4.9750 % URUGUA 4.975 04/20/55	1'300	710	310	1'700 USD	93.01%	1'581'204.00	0.37	a)
US760942BE11	5.7500 % URUGUA 5 3/4 10/28/34	600	1'100	200	1'500 USD	104.97%	1'574'550.00	0.37	a)
US77586TAD81	4.8750 % ROMANI 4 7/8 01/22/24 REGS	550	0	550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US77586TAE64	6.1250 % ROMANI 6 1/8 01/22/44 REGS	500	330	150	680 USD	95.09%	646'598.40	0.15	a)
US836205AP92	6.2500 % SOAF 6 1/4 03/08/41	300	100	0	400 USD	82.38%	329'500.00	0.08	a)
US836205AQ75	4.6650 % SOAF 4.665 01/17/24	550	100	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US836205AR58	5.8750 % SOAF 5 7/8 09/16/25	800	200	0	1'000 USD	99.83%	998'320.00	0.23	a)
US836205AS32	5.3750 % SOAF 5 3/8 07/24/44	400	200	0	600 USD	72.94%	437'625.00	0.10	a)
US836205AT15	4.8750 % SOAF 4 7/8 04/14/26	600	200	0	800 USD	97.44%	779'528.00	0.18	a)
US836205AU87	4.3000 % SOAF 4.3 10/12/28	800	400	200	1'000 USD	90.06%	900'625.00	0.21	a)
US836205AV60	5.0000 % SOAF 5 10/12/46	400	200	0	600 USD	67.94%	407'625.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US836205AW44	4.8500 % SOAF 4.85 09/27/27	400	200	0	600 USD	95.25%	571'500.00	0.13	a)
US836205AX27	5.6500 % SOAF 5.65 09/27/47	600	450	400	650 USD	72.72%	472'671.88	0.11	a)
US836205AY00	5.8750 % SOAF 5 7/8 06/22/30	600	400	200	800 USD	92.75%	742'000.00	0.17	a)
US836205AZ74	6.3000 % SOAF 6.3 06/22/48	200	400	200	400 USD	78.88%	315'500.00	0.07	a)
US836205BA15	4.8500 % SOAF 4.85 09/30/29	800	200	0	1'000 USD	89.84%	898'437.50	0.21	a)
US836205BB97	5.7500 % SOAF 5 3/4 09/30/49	1'200	450	0	1'650 USD	72.81%	1'201'406.25	0.28	a)
US836205BC70	5.8750 % SOAF 5 7/8 04/20/32	450	250	0	700 USD	90.22%	631'531.25	0.15	a)
US836205BE37	7.3000 % SOAF 7.3 04/20/52	600	200	0	800 USD	86.88%	695'000.00	0.16	a)
US857524AC63	4.0000 % POLAND 4 01/22/24	920	220	1'140	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US857524AD47	5.5000 % POLAND 5 1/2 11/16/27	700	410	100	1'010 USD	102.54%	1'035'603.50	0.24	a)
US857524AE20	5.7500 % POLAND 5 3/4 11/16/32	770	280	0	1'050 USD	104.25%	1'094'656.50	0.25	a)
US900123AL40	11.8750 % TURKEY 11 7/8 01/15/30	250	100	0	350 USD	123.84%	433'453.13	0.10	a)
US900123AT75	8.0000 % TURKEY 8 02/14/34	300	0	0	300 USD	103.25%	309'750.00	0.07	a)
US900123AW05	7.3750 % TURKEY 7 3/8 02/05/25	600	400	200	800 USD	101.51%	812'080.00	0.19	a)
US900123AY60	6.8750 % TURKEY 6 7/8 03/17/36	450	320	0	770 USD	93.25%	717'994.20	0.17	a)
US900123BB58	7.2500 % TURKEY 7 1/4 03/05/38	200	0	0	200 USD	95.38%	190'762.00	0.04	a)
US900123BG46	6.7500 % TURKEY 6 3/4 05/30/40	400	250	200	450 USD	88.39%	397'741.50	0.09	a)
US900123BJ84	6.0000 % TURKEY 6 01/14/41	600	200	0	800 USD	81.38%	651'008.00	0.15	a)
US900123CB40	4.8750 % TURKEY 4 7/8 04/16/43	400	250	0	650 USD	69.37%	450'898.50	0.10	a)
US900123CF53	5.7500 % TURKEY 5 3/4 03/22/24	400	200	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US900123CG37	6.6250 % TURKEY 6 5/8 02/17/45	600	200	0	800 USD	84.92%	679'328.00	0.16	a)
US900123CJ75	4.2500 % TURKEY 4 1/4 04/14/26	200	400	200	400 USD	95.88%	383'528.00	0.09	a)
US900123CK49	4.8750 % TURKEY 4 7/8 10/09/26	600	200	0	800 USD	96.38%	771'016.00	0.18	a)
US900123CL22	6.0000 % TURKEY 6 03/25/27	600	200	200	600 USD	98.22%	589'344.00	0.14	a)
US900123CM05	5.7500 % TURKEY 5 3/4 05/11/47	600	250	0	850 USD	74.96%	637'194.00	0.15	a)
US900123CP36	5.1250 % TURKEY 5 1/8 02/17/28	400	0	0	400 USD	94.27%	377'068.00	0.09	a)
US900123CQ19	6.1250 % TURKEY 6 1/8 10/24/28	400	200	0	600 USD	97.15%	582'888.00	0.14	a)
US900123CR91	7.2500 % TURKEY 7 1/4 12/23/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US900123CT57	7.6250 % TURKEY 7 5/8 04/26/29	600	0	0	600 USD	101.80%	610'818.00	0.14	a)
US900123CV04	6.3500 % TURKEY 6.35 08/10/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US900123CW86	5.6000 % TURKEY 5.6 11/14/24	400	400	200	600 USD	99.88%	599'250.00	0.14	a)
US900123CX69	4.2500 % TURKEY 4 1/4 03/13/25	400	0	0	400 USD	98.10%	392'388.00	0.09	a)
US900123CY43	5.2500 % TURKEY 5 1/4 03/13/30	400	0	0	400 USD	89.76%	359'052.00	0.08	a)
US900123CZ18	6.3750 % TURKEY 6 3/8 10/14/25	400	200	0	600 USD	100.20%	601'224.00	0.14	a)
US900123DA57	5.9500 % TURKEY 5.95 01/15/31	300	200	0	500 USD	92.06%	460'310.00	0.11	a)
US900123DB31	4.7500 % TURKEY 4 3/4 01/26/26	200	300	200	300 USD	97.31%	291'937.50	0.07	a)
US900123DC14	5.8750 % TURKEY 5 7/8 06/26/31	400	0	0	400 USD	91.19%	364'750.00	0.08	a)
US900123DD96	6.5000 % TURKEY 6 1/2 09/20/33	200	200	0	400 USD	93.00%	372'000.00	0.09	a)
US900123DF45	9.8750 % TURKEY 9 7/8 01/15/28	700	200	0	900 USD	109.69%	987'192.00	0.23	a)
US900123DG28	9.3750 % TURKEY 9 3/8 01/19/33	0	600	0	600 USD	110.77%	664'620.00	0.15	a)
US900123DH01	9.3750 % TURKEY 9 3/8 03/14/29	0	600	0	600 USD	108.59%	651'562.50	0.15	a)
US900123DJ66	9.1250 % TURKEY 9 1/8 07/13/30	0	1'000	450	550 USD	107.79%	592'856.00	0.14	a)
US91086QAG38	8.3000 % MEX 8.3 08/15/31 MTN	200	0	0	200 USD	118.44%	236'886.00	0.06	a)
US91086QAN88	7.5000 % MEX 7 1/2 04/08/33 MTNA	400	0	250	150 USD	112.23%	168'348.00	0.04	a)
US91086QAS75	6.7500 % MEX 6 3/4 09/27/34 MTNA	200	100	0	300 USD	105.63%	316'875.00	0.07	a)
US91086QAV05	6.0500 % MEX 6.05 01/11/40	400	300	200	500 USD	98.09%	490'425.00	0.11	a)
US91086QAZ19	5.7500 % MEX 5 3/4 10/12/2110 GMTN	380	80	0	460 USD	85.98%	395'485.00	0.09	a)
US91086QBB32	4.7500 % MEX 4 3/4 03/08/44 MTN	500	200	0	700 USD	82.44%	577'080.00	0.13	a)
US91086QBE70	5.5500 % MEX 5.55 01/21/45	400	120	0	520 USD	92.24%	479'632.40	0.11	a)
US91086QBF46	4.6000 % MEX 4.6 01/23/46	400	0	0	400 USD	79.78%	319'120.00	0.07	a)
US91086QBG29	4.1250 % MEX 4 1/8 01/21/26	200	450	400	250 USD	97.83%	244'562.50	0.06	a)
US91087BAB62	4.3500 % MEX 4.35 01/15/47	200	0	0	200 USD	77.00%	153'992.00	0.04	a)
US91087BAC46	4.1500 % MEX 4.15 03/28/27	400	0	0	400 USD	97.74%	390'960.00	0.09	a)
US91087BAD29	4.6000 % MEX 4.6 02/10/48	200	200	0	400 USD	79.03%	316'125.00	0.07	a)
US91087BAE02	3.7500 % MEX 3 3/4 01/11/28	200	200	0	400 USD	94.83%	379'300.00	0.09	a)
US91087BAF76	4.5000 % MEX 4 1/2 04/22/29	400	200	200	400 USD	96.14%	384'560.00	0.09	a)
US91087BAG59	4.5000 % MEX 4 1/2 01/31/50	400	200	200	400 USD	77.90%	311'592.00	0.07	a)
US91087BAH33	3.2500 % MEX 3 1/4 04/16/30	400	0	0	400 USD	88.65%	354'604.00	0.08	a)
US91087BAJ98	3.9000 % MEX 3.9 04/27/25	200	0	0	200 USD	98.37%	196'736.00	0.05	a)
US91087BAK61	4.7500 % MEX 4 3/4 04/27/32	300	200	0	500 USD	94.05%	470'250.00	0.11	a)
US91087BAL45	5.0000 % MEX 5 04/27/51	200	200	0	400 USD	83.20%	332'804.00	0.08	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 USD	in % 7)	Kat.
US91087BAM28	2.6590 % MEX 2.659 05/24/31	600	0	0	600 USD	82.92%	497'538.00	0.12	a)
US91087BAN01	3.7710 % MEX 3.771 05/24/61	400	200	0	600 USD	64.36%	386'130.00	0.09	a)
US91087BAQ32	4.2800 % MEX 4.28 08/14/41	360	400	200	560 USD	79.44%	444'875.20	0.10	a)
US91087BAR15	3.5000 % MEX 3 1/2 02/12/34	300	200	0	500 USD	82.73%	413'640.00	0.10	a)
US91087BAS97	4.4000 % MEX 4.4 02/12/52	400	0	0	400 USD	75.49%	301'968.00	0.07	a)
US91087BAT70	4.8750 % MEX 4 7/8 05/19/33	0	400	0	400 USD	94.10%	376'400.00	0.09	a)
US91087BAU44	5.4000 % MEX 5.4 02/09/28	0	300	0	300 USD	100.37%	301'113.00	0.07	a)
US91087BAV27	6.3500 % MEX 6.35 02/09/35	0	800	200	600 USD	102.34%	614'058.00	0.14	a)
US91087BAX82	6.3380 % MEX 6.338 05/04/53	0	800	400	400 USD	97.54%	390'150.00	0.09	a)
US91087BAY65	5.0000 % MEX 5 05/07/29	0	200	0	200 USD	98.43%	196'856.00	0.05	a)
US91087BAZ31	6.0000 % MEX 6 05/07/36	0	600	0	600 USD	99.73%	598'362.00	0.14	a)
US91087BBA70	6.4000 % MEX 6.4 05/07/54	0	400	0	400 USD	98.59%	394'375.00	0.09	a)
US917288BA96	7.8750 % URUGUA 7 7/8 01/15/33	400	100	0	500 USD	119.29%	596'445.00	0.14	a)
US917288BK78	4.3750 % URUGUA 4 3/8 01/23/31	1'100	600	380	1'320 USD	97.25%	1'283'700.00	0.30	a)
USC7274KAB29	2.1120 % PETMK 2.112 03/23/28 REGS	200	200	0	400 USD	89.28%	357'116.00	0.08	a)
USG13201AA91	5.3330 % MINASG 5.333 02/15/28 REGS	400	0	0	400 USD	98.43%	157'484.80	0.04	a)
USG5852MAA02	9.8750 % MVMOFB 9 7/8 04/08/26 REGS	300	0	0	300 USD	83.25%	249'750.00	0.06	a)
USG8185TAB55	6.3000 % SINOCH 6.3 11/12/40 REGS	100	0	0	100 USD	107.13%	107'125.00	0.02	a)
USG8189YAC87	4.8750 % SINOPE 4 7/8 05/17/42 REGS	200	0	0	200 USD	96.58%	193'151.00	0.04	a)
USG82003AE76	4.3750 % SINOPE 4 3/8 04/10/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG8200QAB26	4.3750 % SINOPE 4 3/8 10/17/23 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG8200QAC09	5.3750 % SINOPE 5 3/8 10/17/43 REGS	200	0	0	200 USD	102.56%	205'112.00	0.05	a)
USG8200TAD21	3.5000 % SINOPE 3 1/2 05/03/26 REGS	0	200	0	200 USD	96.63%	193'250.00	0.04	a)
USG82016AB58	4.1250 % SINOPE 4 1/8 09/12/25 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG82016AC32	4.2500 % SINOPE 4 1/4 09/12/28 REGS	200	0	0	200 USD	97.88%	195'750.00	0.05	a)
USG82016AF62	2.5000 % SINOPE 2 1/2 08/08/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG82016AH29	2.9500 % SINOPE 2.95 08/08/29 REGS	0	200	0	200 USD	91.23%	182'459.00	0.04	a)
USG82016AJ84	3.6800 % SINOPE 3.68 08/08/49 REGS	0	200	0	200 USD	79.17%	158'336.00	0.04	a)
USG82016AK57	2.5000 % SINOPE 2 1/2 11/12/24 REGS	0	200	0	200 USD	97.78%	195'562.00	0.05	a)
USG82016AL31	2.9500 % SINOPE 2.95 11/12/29 REGS	200	0	0	200 USD	91.26%	182'526.00	0.04	a)
USG82016AN96	2.1500 % SINOPE 2.15 05/13/25 REGS	200	0	0	200 USD	96.33%	192'654.00	0.04	a)
USG82016AP45	2.7000 % SINOPE 2.7 05/13/30 REGS	200	200	0	400 USD	89.34%	357'340.00	0.08	a)
USG82016AR01	1.4500 % SINOPE 1.45 01/08/26 REGS	200	200	0	400 USD	93.61%	374'452.00	0.09	a)
USG82016AS83	2.3000 % SINOPE 2.3 01/08/31 REGS	200	0	0	200 USD	85.91%	171'824.00	0.04	a)
USG82016AT66	3.1000 % SINOPE 3.1 01/08/51 REGS	0	200	0	200 USD	70.25%	140'500.00	0.03	a)
USG8201JAC56	3.2500 % SINOPE 3 1/4 04/28/25 REGS	200	200	0	400 USD	97.56%	390'252.00	0.09	a)
USG8201JAE13	4.1000 % SINOPE 4.1 04/28/45 REGS	200	0	0	200 USD	86.37%	172'742.00	0.04	a)
USG8201NAC68	3.6250 % SINOPE 3 5/8 04/12/27 REGS	200	200	200	200 USD	96.25%	192'500.00	0.04	a)
USG8201NAH55	3.2500 % SINOPE 3 1/4 09/13/27 REGS	0	200	0	200 USD	94.66%	189'320.00	0.04	a)
USG8449VAC03	4.3750 % CHGRID 4 3/8 05/22/43 REGS	0	200	0	200 USD	91.05%	182'096.00	0.04	a)
USG8449WAC85	4.1250 % CHGRID 4 1/8 05/07/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USG8449WAD68	4.8500 % CHGRID 4.85 05/07/44 REGS	200	0	0	200 USD	96.70%	193'394.00	0.04	a)
USG8450LAC84	2.8750 % CHGRID 2 7/8 05/18/26 REGS	0	200	0	200 USD	95.43%	190'856.00	0.04	a)
USG8450LAJ38	3.5000 % CHGRID 3 1/2 05/04/27 REGS	400	600	200	800 USD	95.99%	767'900.00	0.18	a)
USG8450LAP97	4.2500 % CHGRID 4 1/4 05/02/28 REGS	200	0	0	200 USD	98.10%	196'208.00	0.05	a)
USG8850LAA82	3.7000 % YANTZE 3.7 06/10/25 REGS	250	0	0	250 USD	98.07%	245'180.00	0.06	a)
USG8850LAC49	3.1500 % YANTZE 3.15 06/02/26 REGS	200	200	0	400 USD	95.87%	383'488.00	0.09	a)
USM88269US88	8.6000 % TURKEY 8.6 09/24/27	400	0	0	400 USD	105.53%	422'125.00	0.10	a)
USP0092AAF68	4.0000 % AITOCU 4 08/11/41 REGS	200	0	0	200 USD	71.28%	142'562.50	0.03	a)
USP0092AAG42	5.1250 % AITOCU 5 1/8 08/11/61 REGS	400	200	0	600 USD	70.20%	421'206.00	0.10	a)
USP01012AN67	7.6500 % ELSALV 7.65 06/15/35 REGS	540	0	0	540 USD	75.06%	405'337.50	0.09	a)
USP01012AR71	7.6250 % ELSALV 7 5/8 02/01/41 REGS	300	350	150	500 USD	72.90%	364'520.00	0.08	a)
USP01012AT38	6.3750 % ELSALV 6 3/8 01/18/27 REGS	380	140	0	520 USD	86.02%	447'319.60	0.10	a)
USP01012BX31	8.6250 % ELSALV 8 5/8 02/28/29 REGS	310	100	0	410 USD	87.13%	357'212.50	0.08	a)
USP01012CA29	7.1246 % ELSALV 7.1246 01/20/50 REGS	600	150	0	750 USD	68.35%	512'640.00	0.12	a)
USP01012CC84	9.5000 % ELSALV 9 1/2 07/15/52 REGS	500	150	0	650 USD	83.55%	543'075.00	0.13	a)
USP14517AA73	4.3750 % BNCE 4 3/8 10/14/25 REGS	200	0	0	200 USD	98.15%	196'294.00	0.05	a)
USP1559LAA72	2.5000 % BCNAL 2 1/2 08/11/30 REGS	400	0	0	400 USD	75.91%	303'628.00	0.07	a)
USP29595AB42	4.7500 % CFELEC 4 3/4 02/23/27 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP29595AD08	3.3480 % CFELEC 3.348 02/09/31 REGS	200	0	0	200 USD	83.31%	166'625.00	0.04	a)
USP29595AE80	4.6770 % CFELEC 4.677 02/09/51 REGS	200	0	0	200 USD	70.03%	140'050.00	0.03	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 USD	in % 7)	Kat.
USP30179AM09	4.8750 % CFELEC 4 7/8 01/15/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP30179BK34	3.8750 % CFELEC 3 7/8 07/26/33 REGS	200	200	0	400 USD	81.63%	326'500.00	0.08 a)	
USP30179BQ04	4.6880 % CFELEC 4.688 05/15/29 REGS	0	200	0	200 USD	94.13%	188'250.00	0.04 a)	
USP30179BR86	6.2640 % CFELEC 6.264 02/15/52 REGS	200	0	0	200 USD	86.62%	173'235.00	0.04 a)	
USP3143NAG99	5.6250 % CDEL 5 5/8 09/21/35 REGS	100	100	0	200 USD	96.20%	192'406.00	0.04 a)	
USP3143NAH72	6.1500 % CDEL 6.15 10/24/36 REGS	100	0	0	100 USD	99.42%	99'419.00	0.02 a)	
USP3143NAQ71	4.2500 % CDEL 4 1/4 07/17/42 REGS	200	0	0	200 USD	77.12%	154'244.00	0.04 a)	
USP3143NAS38	5.6250 % CDEL 5 5/8 10/18/43 REGS	200	400	200	400 USD	91.47%	365'875.00	0.09 a)	
USP3143NAU83	4.8750 % CDEL 4 7/8 11/04/44 REGS	200	0	0	200 USD	82.24%	164'482.00	0.04 a)	
USP3143NAY06	3.6250 % CDEL 3 5/8 08/01/27 REGS	400	0	0	400 USD	94.16%	376'625.00	0.09 a)	
USP3143NAZ70	4.5000 % CDEL 4 1/2 08/01/47 REGS	200	200	0	400 USD	77.37%	309'472.00	0.07 a)	
USP3143NBB93	4.3750 % CDEL 4 3/8 02/05/49 REGS	400	0	0	400 USD	75.93%	303'700.00	0.07 a)	
USP3143NBE33	3.0000 % CDEL 3 09/30/29 REGS	200	200	0	400 USD	87.67%	350'660.00	0.08 a)	
USP3143NBF08	3.7000 % CDEL 3.7 01/30/50 REGS	800	0	0	800 USD	67.34%	538'728.00	0.13 a)	
USP3143NBH63	3.1500 % CDEL 3.15 01/14/30 REGS	200	400	200	400 USD	87.31%	349'232.00	0.08 a)	
USP3143NBK92	3.7500 % CDEL 3 3/4 01/15/31 REGS	200	0	0	200 USD	88.36%	176'718.00	0.04 a)	
USP3143NBM58	3.1500 % CDEL 3.15 01/15/51 REGS	200	0	0	200 USD	60.95%	121'902.00	0.03 a)	
USP3143NBP89	5.1250 % CDEL 5 1/8 02/02/33 REGS	0	300	0	300 USD	93.89%	281'667.00	0.07 a)	
USP3143NBQ62	5.9500 % CDEL 5.95 01/08/34 REGS	0	300	0	300 USD	98.84%	296'531.25	0.07 a)	
USP3143NBR46	6.3000 % CDEL 6.3 09/08/53 REGS	0	200	0	200 USD	97.06%	194'128.00	0.05 a)	
USP3579EAY34	7.4500 % DOMREP 7.45 04/30/44 REGS	650	350	200	800 USD	104.50%	836'000.00	0.19 a)	
USP3579EBD87	5.5000 % DOMREP 5 1/2 01/27/25 REGS	500	200	0	700 USD	99.38%	695'625.00	0.16 a)	
USP3579EBE60	6.8500 % DOMREP 6.85 01/27/45 REGS	750	450	250	950 USD	98.20%	932'900.00	0.22 a)	
USP3579EBK21	6.8750 % DOMREP 6 7/8 01/29/26 REGS	600	300	150	750 USD	101.06%	757'968.75	0.18 a)	
USP3579EBV85	5.9500 % DOMREP 5.95 01/25/27 REGS	600	300	0	900 USD	99.79%	898'101.00	0.21 a)	
USP3579EBY25	6.5000 % DOMREP 6 1/2 02/15/48 REGS	400	150	0	550 USD	94.82%	521'510.00	0.12 a)	
USP3579ECB13	6.0000 % DOMREP 6 07/19/28 REGS	500	450	300	650 USD	99.73%	648'212.50	0.15 a)	
USP3579ECE51	6.4000 % DOMREP 6.4 06/05/49 REGS	600	300	150	750 USD	93.41%	700'546.88	0.16 a)	
USP3579ECF27	4.5000 % DOMREP 4 1/2 01/30/30 REGS	700	600	150	1'150 USD	90.82%	1'044'441.50	0.24 a)	
USP3579ECG00	5.8750 % DOMREP 5 7/8 01/30/60 REGS	1'200	680	150	1'730 USD	84.46%	1'461'175.30	0.34 a)	
USP3579ECH82	4.8750 % DOMREP 4 7/8 09/23/32 REGS	1'250	600	200	1'650 USD	89.05%	1'469'292.00	0.34 a)	
USP3579ECJ49	5.3000 % DOMREP 5.3 01/21/41 REGS	500	350	0	850 USD	83.95%	713'575.00	0.17 a)	
USP3579ECN50	6.0000 % DOMREP 6 02/22/33 REGS	750	300	150	900 USD	96.65%	869'850.00	0.20 a)	
USP3579ECP09	5.5000 % DOMREP 5 1/2 02/22/29 REGS	800	300	200	900 USD	96.73%	870'543.00	0.20 a)	
USP3579ECR64	7.0500 % DOMREP 7.05 02/03/31 REGS	0	350	0	350 USD	102.90%	360'150.00	0.08 a)	
USP3699PGE18	4.3750 % COSTAR 4 3/8 04/30/25 REGS	200	400	200	400 USD	98.53%	394'100.00	0.09 a)	
USP3699PGF82	5.6250 % COSTAR 5 5/8 04/30/43 REGS	200	400	200	400 USD	89.95%	359'800.00	0.08 a)	
USP3699PGH49	7.0000 % COSTAR 7 04/04/44 REGS	600	0	0	600 USD	102.53%	615'150.00	0.14 a)	
USP3699PGJ05	7.1580 % COSTAR 7.158 03/12/45 REGS	600	200	0	800 USD	103.81%	830'500.00	0.19 a)	
USP3699PGK77	6.1250 % COSTAR 6 1/8 02/19/31 REGS	600	200	0	800 USD	101.45%	811'600.00	0.19 a)	
USP3699PGM34	6.5500 % COSTAR 6.55 04/03/34 REGS	0	1'050	200	850 USD	103.18%	877'064.00	0.20 a)	
USP3699PGN17	7.3000 % COSTAR 7.3 11/13/54 REGS	0	1'050	0	1'050 USD	105.47%	1'107'466.50	0.26 a)	
USP37110AJ50	4.3750 % ENAPCL 4 3/8 10/30/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP37110AK24	3.7500 % ENAPCL 3 3/4 08/05/26 REGS	200	0	0	200 USD	95.06%	190'125.00	0.04 a)	
USP37110AM89	4.5000 % ENAPCL 4 1/2 09/14/47 REGS	200	0	0	200 USD	73.69%	147'375.00	0.03 a)	
USP37110AN62	5.2500 % ENAPCL 5 1/4 11/06/29 REGS	200	0	0	200 USD	96.84%	193'678.00	0.05 a)	
USP37110AR76	3.4500 % ENAPCL 3.45 09/16/31 REGS	0	200	0	200 USD	84.17%	168'346.00	0.04 a)	
USP37110AS59	6.1500 % ENAPCL 6.15 05/10/33 REGS	0	200	0	200 USD	99.78%	199'564.00	0.05 a)	
USP37146AA81	5.1250 % EMTESA 5 1/8 05/02/49 REGS	200	0	0	200 USD	71.74%	143'482.00	0.03 a)	
USP3742RAW09	3.0680 % BFFCC 3.068 08/18/50 REGS	200	0	0	200 USD	60.23%	120'452.00	0.03 a)	
USP3742RAX81	3.8300 % BFFCC 3.83 09/14/61 REGS	200	0	0	200 USD	66.21%	132'426.00	0.03 a)	
USP37466AP78	5.0000 % BMETR 5 01/25/47 REGS	200	0	0	200 USD	85.46%	170'926.00	0.04 a)	
USP37466AR35	3.6500 % BMETR 3.65 05/07/30 REGS	200	0	0	200 USD	91.16%	182'312.50	0.04 a)	
USP37466AS18	4.7000 % BMETR 4.7 05/07/50 REGS	200	0	0	200 USD	80.69%	161'375.00	0.04 a)	
USP37466AT90	3.6930 % BMETR 3.693 09/13/61 REGS	0	200	0	200 USD	65.38%	130'750.00	0.03 a)	
USP37878AC26	4.5000 % BOLIVI 4 1/2 03/20/28 REGS	400	200	0	600 USD	58.53%	351'150.00	0.08 a)	
USP37878AE81	7.5000 % BOLIVI 7 1/2 03/02/30 REGS	450	200	0	650 USD	59.66%	387'765.63	0.09 a)	
USP3R94GAY57	2.4000 % COFIDE 2.4 09/28/27 REGS	200	0	0	200 USD	89.25%	178'508.00	0.04 a)	
USP42009AE34	4.6250 % MIVIVI 4 5/8 04/12/27 REGS	150	150	0	300 USD	97.00%	291'000.00	0.07 a)	
USP48864AQ80	6.5000 % BARBAD 6 1/2 10/01/29 REGS	300	0	0	300 USD	94.84%	284'512.50	0.07 a)	
USP5015VAE67	4.8750 % GUATEM 4 7/8 02/13/28 REGS	400	0	0	400 USD	96.16%	384'625.00	0.09 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
USP5015VAF33	4.5000 % GUATEM 4 1/2 05/03/26 REGS	400	0	0	400 USD	97.25%	389'016.00	0.09	a)
USP5015VAG16	4.3750 % GUATEM 4 3/8 06/05/27 REGS	200	200	0	400 USD	95.66%	382'620.00	0.09	a)
USP5015VAH98	4.9000 % GUATEM 4.9 06/01/30 REGS	200	200	0	400 USD	94.99%	379'960.00	0.09	a)
USP5015VAJ54	6.1250 % GUATEM 6 1/8 06/01/50 REGS	800	200	0	1'000 USD	91.39%	913'875.00	0.21	a)
USP5015VAK28	5.3750 % GUATEM 5 3/8 04/24/32 REGS	200	0	0	200 USD	95.69%	191'372.00	0.04	a)
USP5015VAM83	3.7000 % GUATEM 3.7 10/07/33 REGS	300	0	0	300 USD	81.93%	245'775.00	0.06	a)
USP5015VAN66	4.6500 % GUATEM 4.65 10/07/41 REGS	200	200	0	400 USD	79.46%	317'852.00	0.07	a)
USP5015VAP15	5.2500 % GUATEM 5 1/4 08/10/29 REGS	250	0	0	250 USD	96.29%	240'735.00	0.06	a)
USP5015VAQ97	6.6000 % GUATEM 6.6 06/13/36 REGS	0	700	0	700 USD	101.08%	707'525.00	0.16	a)
USP5015VAR70	7.0500 % GUATEM 7.05 10/04/32 REGS	0	400	0	400 USD	105.25%	421'000.00	0.10	a)
USP5076HAA16	9.0000 % TPHLTT 9 08/12/29 REGS	200	200	0	400 USD	105.33%	421'300.00	0.10	a)
USP5178RAC27	6.2500 % HONDUR 6 1/4 01/19/27 REGS	350	150	0	500 USD	95.90%	479'520.00	0.11	a)
USP5178RAD00	5.6250 % HONDUR 5 5/8 06/24/30 REGS	350	0	0	350 USD	87.44%	306'054.00	0.07	a)
USP56226AQ94	6.3750 % COSICE 6 3/8 05/15/43 REGS	200	200	0	400 USD	86.98%	347'900.00	0.08	a)
USP6629MAA01	4.2500 % MEXCAT 4 1/4 10/31/26 REGS	200	0	0	200 USD	96.15%	192'308.00	0.04	a)
USP6629MAB83	5.5000 % MEXCAT 5 1/2 10/31/46 REGS	200	0	0	200 USD	82.96%	165'924.00	0.04	a)
USP6629MAD40	5.5000 % MEXCAT 5 1/2 07/31/47 REGS	400	0	0	400 USD	83.20%	332'816.00	0.08	a)
USP68788AA97	9.2500 % SURINM 9 1/4 10/26/26 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP68788AC53	7.9500 % SURINM 7.95 07/15/33 REGS	0	322	0	322 USD	88.16%	283'627.75	0.07	a)
USP75744AB11	6.1000 % PARGUY 6.1 08/11/44 REGS	400	200	0	600 USD	95.00%	570'000.00	0.13	a)
USP75744AD76	5.0000 % PARGUY 5 04/15/26 REGS	200	200	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP75744AE59	4.7000 % PARGUY 4.7 03/27/27 REGS	200	400	200	400 USD	96.86%	387'440.00	0.09	a)
USP75744AF25	5.6000 % PARGUY 5.6 03/13/48 REGS	400	0	0	400 USD	88.62%	354'492.00	0.08	a)
USP75744AG08	5.4000 % PARGUY 5.4 03/30/50 REGS	600	200	0	800 USD	85.99%	687'936.00	0.16	a)
USP75744AJ47	4.9500 % PARGUY 4.95 04/28/31 REGS	400	200	0	600 USD	95.95%	575'688.00	0.13	a)
USP75744AK10	2.7390 % PARGUY 2.739 01/29/33 REGS	400	0	0	400 USD	80.24%	320'948.00	0.07	a)
USP75744AL92	3.8490 % PARGUY 3.849 06/28/33 REGS	280	0	0	280 USD	86.41%	241'939.60	0.06	a)
USP75744AM75	5.8500 % PARGUY 5.85 08/21/33 REGS	0	400	0	400 USD	99.06%	396'232.00	0.09	a)
USP7808BAA54	4.7500 % PETRPE 4 3/4 06/19/32 REGS	400	200	0	600 USD	78.56%	471'375.00	0.11	a)
USP7808BAB38	5.6250 % PETRPE 5 5/8 06/19/47 REGS	700	200	0	900 USD	68.50%	616'500.00	0.14	a)
USP78625ED13	10.0000 % PEMEX 10 02/07/33 REGS	0	330	330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP78PAYAB53	5.6250 % 5.625 PETRO 47NTS-5	0	900	900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP93960AF25	4.3750 % TRITOB 4 3/8 01/16/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USP93960AG08	4.5000 % TRITOB 4 1/2 08/04/26 REGS	600	0	0	600 USD	96.77%	580'590.00	0.14	a)
USP93960AH80	4.5000 % TRITOB 4 1/2 06/26/30 REGS	200	200	0	400 USD	93.82%	375'268.00	0.09	a)
USP93960AJ47	5.9500 % TRITOB 5.95 01/14/31 REGS	0	300	0	300 USD	100.17%	300'504.00	0.07	a)
USP9400VAA90	5.2500 % TRNGEN 5 1/4 11/04/27 REGS	400	0	0	400 USD	97.48%	389'920.00	0.09	a)
USY15025AA02	0.4000 % CHINA 0.4 10/21/23 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY15025AB84	0.5500 % CHINA 0.55 10/21/25 REGS	400	200	0	600 USD	93.25%	559'494.00	0.13	a)
USY15025AC67	1.2000 % CHINA 1.2 10/21/30 REGS	200	200	0	400 USD	82.34%	329'356.00	0.08	a)
USY15025AD41	2.2500 % CHINA 2 1/4 10/21/50 REGS	200	0	0	200 USD	63.56%	127'122.00	0.03	a)
USY20721AE96	8.5000 % INDON 8 1/2 10/12/35 REGS	200	100	0	300 USD	126.96%	380'877.00	0.09	a)
USY20721AJ83	6.6250 % INDON 6 5/8 02/17/37 REGS	200	100	0	300 USD	111.56%	334'677.00	0.08	a)
USY20721AL30	7.7500 % INDON 7 3/4 01/17/38 REGS	400	0	0	400 USD	122.71%	490'828.00	0.11	a)
USY20721BB49	5.2500 % INDON 5 1/4 01/17/42 REGS	400	0	0	400 USD	99.19%	396'750.00	0.09	a)
USY20721BE87	4.6250 % INDON 4 5/8 04/15/43 REGS	200	200	0	400 USD	92.03%	368'125.00	0.09	a)
USY20721BG36	4.1250 % INDON 4 1/8 01/15/25 REGS	400	0	0	400 USD	99.25%	397'008.00	0.09	a)
USY20721BJ74	5.8750 % INDON 5 7/8 01/15/24 REGS	200	200	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY20721BK48	6.7500 % INDON 6 3/4 01/15/44 REGS	400	200	200	400 USD	115.91%	463'625.00	0.11	a)
USY20721BM04	5.1250 % INDON 5 1/8 01/15/45 REGS	400	0	0	400 USD	97.62%	390'460.00	0.09	a)
USY20721BN86	4.7500 % INDON 4 3/4 01/08/26 REGS	400	0	0	400 USD	99.56%	398'244.00	0.09	a)
USY20721BP35	5.9500 % INDON 5.95 01/08/46 REGS	200	0	0	200 USD	106.03%	212'050.00	0.05	a)
USY20721BQ18	4.3500 % INDON 4.35 01/08/27 REGS	200	200	0	400 USD	98.26%	393'032.00	0.09	a)
USY20721BR90	5.2500 % INDON 5 1/4 01/08/47 REGS	200	400	200	400 USD	98.56%	394'236.00	0.09	a)
USY20721BT56	3.8500 % INDON 3.85 07/18/27 REGS	200	0	0	200 USD	96.59%	193'184.00	0.04	a)
USY20721BU20	4.7500 % INDON 4 3/4 07/18/47 REGS	200	0	0	200 USD	92.66%	185'328.00	0.04	a)
USY23862AF56	3.6250 % EXIMCH 3 5/8 07/31/24 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY5325QAD44	0.7500 % CHINA 0 3/4 10/26/24 REGS	250	0	0	250 USD	97.23%	243'065.00	0.06	a)
USY5325QAE27	1.2500 % CHINA 1 1/4 10/26/26 REGS	300	200	0	500 USD	91.78%	458'895.00	0.11	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 USD	in % 7)	Kat.
USY5325QAF91	1.7500 % CHINA 1 3/4 10/26/31 REGS	200	200	0	400 USD	84.03%	336'125.00	0.08	a)
USY54788AA57	3.1790 % MALAYS 3.179 04/27/26 REGS	500	500	250	750 USD	96.69%	725'156.25	0.17	a)
USY54788AB31	4.0800 % MALAYS 4.08 04/27/46 REGS	250	0	0	250 USD	89.49%	223'717.50	0.05	a)
USY5749LAA99	3.0430 % MALAYS 3.043 04/22/25 REGS	400	200	0	600 USD	97.82%	586'914.00	0.14	a)
USY5749LAB72	4.2360 % MALAYS 4.236 04/22/45 REGS	200	200	0	400 USD	91.81%	367'250.00	0.09	a)
USY57542AA32	2.0700 % MALAYS 2.07 04/28/31 REGS	250	250	0	500 USD	85.03%	425'156.25	0.10	a)
USY57542AB15	3.0750 % MALAYS 3.075 04/28/51 REGS	250	0	0	250 USD	73.82%	184'547.50	0.04	a)
USY6142NAC21	5.1250 % MONGOL 5 1/8 04/07/26 REGS	400	0	0	400 USD	96.66%	386'640.00	0.09	a)
USY6142NAE86	4.4500 % MONGOL 4.45 07/07/31 REGS	200	400	200	400 USD	83.61%	334'436.00	0.08	a)
USY6142NAF51	3.5000 % MONGOL 3 1/2 07/07/27 REGS	200	0	0	200 USD	88.49%	176'974.00	0.04	a)
USY6142NAG35	8.6500 % MONGOL 8.65 01/19/28 REGS	0	420	0	420 USD	103.68%	435'435.00	0.10	a)
USY67265AP66	8.3750 % PNGIB 8 3/8 10/04/28 REGS	200	200	0	400 USD	93.75%	375'000.00	0.09	a)
USY68851AK32	7.6250 % PETMK 7 5/8 10/15/26 REGS	150	150	0	300 USD	105.93%	317'781.00	0.07	a)
USY68856AN67	3.5000 % PETMK 3 1/2 03/18/25 REGS	800	200	0	1'000 USD	98.02%	980'180.00	0.23	a)
USY68856AQ98	4.5000 % PETMK 4 1/2 03/18/45 REGS	800	400	200	1'000 USD	87.79%	877'875.00	0.20	a)
USY68856AT38	3.5000 % PETMK 3 1/2 04/21/30 REGS	1'200	600	400	1'400 USD	91.47%	1'280'562.50	0.30	a)
USY68856AV83	4.5500 % PETMK 4.55 04/21/50 REGS	1'400	900	400	1'900 USD	88.17%	1'675'135.00	0.39	a)
USY68856AW66	4.8000 % PETMK 4.8 04/21/60 REGS	400	200	0	600 USD	90.27%	541'638.00	0.13	a)
USY6886MAC48	3.4040 % PETMK 3.404 04/28/61 REGS	900	200	0	1'100 USD	68.14%	749'529.00	0.17	a)
USY6886MAE04	2.4800 % PETMK 2.48 01/28/32 REGS	600	400	200	800 USD	83.14%	665'156.00	0.15	a)
USY6972HLP91	4.2000 % PHILIP 4.2 03/29/47	200	200	0	400 USD	83.61%	334'424.00	0.08	a)
USY7083VAD11	7.3900 % PSALM 7.39 12/02/24 REGS	350	100	0	450 USD	101.47%	456'624.00	0.11	a)
USY7133MAC39	4.2500 % PLBIJ 4 1/4 05/05/25 REGS	0	400	0	400 USD	98.32%	393'264.00	0.09	a)
USY7138AAD29	6.0000 % PERTIJ 6 05/03/42 REGS	200	0	0	200 USD	99.63%	199'250.00	0.05	a)
USY7138AAF76	5.6250 % PERTIJ 5 5/8 05/20/43 REGS	200	200	0	400 USD	95.53%	382'112.00	0.09	a)
USY7140DAA82	4.8750 % PLBIJ 4 7/8 10/01/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
USY7140WAC20	6.5300 % IDASAL 6.53 11/15/28 REGS	0	200	0	200 USD	103.27%	206'544.00	0.05	a)
USY7140WAE85	4.7500 % IDASAL 4 3/4 05/15/25 REGS	200	0	0	200 USD	98.64%	197'274.00	0.05	a)
USY7140WAF50	5.4500 % IDASAL 5.45 05/15/30 REGS	200	0	0	200 USD	97.88%	195'752.00	0.05	a)
USY7140WAG34	5.8000 % IDASAL 5.8 05/15/50 REGS	0	200	0	200 USD	92.45%	184'906.00	0.04	a)
USY7141MAA72	3.7500 % HAKAUJ 3 3/4 05/11/30 REGS	200	0	0	200 USD	91.77%	183'536.00	0.04	a)
USY7329CAA37	5.0450 % PHILIP 5.045 06/06/29 REGS	0	400	0	400 USD	99.71%	398'836.00	0.09	a)
USY8137FAC24	6.1250 % SRILAN 6 1/8 06/03/25 REGS	200	200	0	400 USD	55.48%	221'904.00	0.05	a)
USY8137FAE89	6.8500 % SRILAN 6.85 11/03/25 REGS	600	400	0	1'000 USD	55.01%	550'110.00	0.13	a)
USY8137FAF54	6.8250 % SRILAN 6.825 07/18/26 REGS	600	0	0	600 USD	55.37%	332'190.00	0.08	a)
USY8137FAH11	6.2000 % SRILAN 6.2 05/11/27 REGS	500	700	300	900 USD	53.74%	483'642.00	0.11	a)
USY8137FAK40	5.7500 % SRILAN 5 3/4 04/18/23 REGS	550	200	0	750 USD	54.77%	410'767.50	0.10	a)
USY8137FAL23	6.7500 % SRILAN 6 3/4 04/18/28 REGS	600	200	0	800 USD	53.82%	430'592.00	0.10	a)
USY8137FAN88	6.8500 % SRILAN 6.85 03/14/24 REGS	400	200	0	600 USD	54.21%	325'278.00	0.08	a)
USY8137FAP37	7.8500 % SRILAN 7.85 03/14/29 REGS	600	200	0	800 USD	53.32%	426'568.00	0.10	a)
USY8137FAQ10	6.3500 % SRILAN 6.35 06/28/24 REGS	200	0	0	200 USD	54.26%	108'526.00	0.03	a)
USY8137FAR92	7.5500 % SRILAN 7.55 03/28/30 REGS	800	0	0	800 USD	53.31%	426'512.00	0.10	a)
USY9384AAA87	4.8000 % VIETNM 4.8 11/19/24 REGS	600	0	0	600 USD	99.05%	594'291.00	0.14	a)
XS0113419690	9.7500 % QATAR 9 3/4 06/15/30 REGS	300	250	0	550 USD	128.03%	704'171.88	0.16	a)
XS0146173371	8.2500 % ELSALV 8 1/4 04/10/32 REGS	400	100	100	400 USD	82.66%	330'625.00	0.08	a)
XS0250882478	8.2500 % LEBAN 8 1/4 04/12/21 REGS	300	0	0	300 USD	5.75%	17'250.00	0.00	a)
XS0308427581	6.8500 % DPWDU 6.85 07/02/37 REGS	370	0	0	370 USD	108.16%	400'188.30	0.09	a)
XS0468535637	6.4000 % QATAR 6.4 01/20/40 REGS	300	0	0	300 USD	112.75%	338'250.00	0.08	a)
XS0505478684	6.8750 % EGYPT 6 7/8 04/30/40 REGS	200	100	0	300 USD	72.53%	217'575.00	0.05	a)
XS0559237796	6.1000 % LEBAN 6.1 10/04/22 EMTN	950	0	0	950 USD	5.75%	54'625.00	0.01	a)
XS0615236188	5.7500 % QATAR 5 3/4 01/20/42 REGS	200	600	600	200 USD	106.27%	212'534.00	0.05	a)
XS0701227075	6.8750 % MUBAUH 6 7/8 11/01/41 REGS	0	200	0	200 USD	115.81%	231'625.00	0.05	a)
XS0707820659	6.6000 % LEBAN 6.6 11/27/26 GMTN	450	0	0	450 USD	5.75%	25'875.00	0.01	a)
XS0828779594	5.3750 % ZAMBIN 5 3/8 09/20/22 REGS	400	0	0	400 USD	60.99%	243'940.00	0.06	a)
XS0859366899	6.7500 % LEBAN 6 3/4 11/29/27	390	0	0	390 USD	5.75%	22'425.00	0.01	a)
XS0859367194	6.0000 % LEBAN 6 01/27/23	550	0	0	550 USD	5.75%	31'625.00	0.01	a)
XS0864259717	5.5000 % MOROC 5 1/2 12/11/42 REGS	400	400	200	600 USD	86.56%	519'375.00	0.12	a)
XS0880597603	5.2500 % DUGB 5 1/4 01/30/43 EMTN	200	0	0	200 USD	94.87%	189'740.00	0.04	a)
XS0997000251	6.0000 % CROATI 6 01/26/24 REGS	800	200	1'000	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 USD	in % 7)	Kat.
XS1028952403	6.8750 % KENINT 6 7/8 06/24/24 REGS	1'000	400	1'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1044540547	4.7500 % AZERBJ 4 3/4 03/18/24 REGS	400	200	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1056386714	8.5000 % ZAMBIN 8 1/2 04/14/24 REGS	400	200	0	600 USD	67.88%	407'250.00	0.09	a)
XS1056560920	8.2500 % PKSTAN 8 1/4 04/15/24 REGS	400	250	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1106137687	3.7640 % SHARSK 3.764 09/17/24	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1108847531	8.1250 % GHANA 8 1/8 01/18/26 REGS	600	0	0	600 USD	45.25%	271'500.00	0.06	a)
XS1110833123	6.0000 % BHRAIN 6 09/19/44 REGS	600	0	0	600 USD	80.69%	484'140.00	0.11	a)
XS1117279882	6.1250 % JORDAN 6 1/8 01/29/26 REGS	600	0	0	600 USD	98.34%	590'016.00	0.14	a)
XS1120403313	4.3250 % DIFCAE 4.325 11/12/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1120709669	3.8750 % KAZAKS 3 7/8 10/14/24 REGS	800	0	400	400 USD	99.58%	398'332.00	0.09	a)
XS1120709826	4.8750 % KAZAKS 4 7/8 10/14/44 REGS	400	200	0	600 USD	93.64%	561'840.00	0.13	a)
XS1125272143	5.6250 % CHITRA 5 5/8 11/03/24	200	0	0	200 USD	99.84%	199'687.50	0.05	a)
XS1141043296	4.4890 % TURKSK 4.489 11/25/24 REGS	200	0	0	200 USD	99.07%	198'134.00	0.05	a)
XS1151974877	6.6250 % ETHOPI 6 5/8 12/11/24 REGS	600	0	0	600 USD	69.14%	414'816.00	0.10	a)
XS1175223699	5.7500 % TUNIS 5 3/4 01/30/25 REGS	600	0	0	600 USD	92.27%	553'638.00	0.13	a)
XS1187065443	7.1250 % ESKOM 7 1/8 02/11/25 REGS	400	400	0	800 USD	99.50%	796'032.00	0.19	a)
XS1196417569	6.2000 % LEBAN 6.2 02/26/25 GMTN	500	0	0	500 USD	5.75%	28'750.00	0.01	a)
XS1196419854	6.6500 % LEBAN 6.65 02/26/30 GMTN	510	0	0	510 USD	5.75%	29'325.00	0.01	a)
XS1196496688	6.9500 % SOIAZ 6.95 03/18/30	400	200	0	600 USD	102.54%	615'240.00	0.14	a)
XS1196517434	6.3750 % IVYCT 6 3/8 03/03/28 REGS	450	0	0	450 USD	96.94%	436'218.75	0.10	a)
XS1207654853	7.1500 % ARMEN 7.15 03/26/25 REGS	200	200	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1210507650	3.0940 % RAKS 3.094 03/31/25 EMTN	200	0	0	200 USD	97.31%	194'625.00	0.05	a)
XS1245432742	5.8750 % EGYPT 5 7/8 06/11/25 REGS	600	400	200	800 USD	98.55%	788'392.00	0.18	a)
XS1245960684	6.9500 % GABON 6.95 06/16/25 REGS	400	0	0	400 USD	96.31%	385'228.00	0.09	a)
XS1263054519	5.1250 % KAZAKS 5 1/8 07/21/25 REGS	1'200	450	0	1'650 USD	100.94%	1'665'468.75	0.39	a)
XS1263139856	6.5000 % KAZAKS 6 1/2 07/21/45 REGS	800	400	200	1'000 USD	110.65%	1'106'500.00	0.26	a)
XS1265180643	4.7500 % MINMET 4 3/4 07/30/25	200	0	0	200 USD	98.73%	197'456.00	0.05	a)
XS1267081575	8.9700 % ZAMBIN 8.97 07/30/27 REGS	600	0	0	600 USD	67.50%	405'000.00	0.09	a)
XS1297557412	10.7500 % GHANA 10 3/4 10/14/30 REGS	400	200	0	600 USD	62.63%	375'768.00	0.09	a)
XS1299811486	8.2500 % PKSTAN 8 1/4 09/30/25 REGS	200	200	0	400 USD	88.26%	353'044.00	0.08	a)
XS1311099540	5.2500 % REPNAM 5 1/4 10/29/25 REGS	400	0	0	400 USD	98.82%	395'272.00	0.09	a)
XS1313647841	6.2500 % LEBAN 6 1/4 11/04/24 GMTN	100	0	0	100 USD	5.75%	5'750.00	0.00	a)
XS1313654623	7.0500 % LEBAN 7.05 11/02/35 GMTN	200	0	0	200 USD	5.75%	11'500.00	0.00	a)
XS1313675974	6.6500 % LEBAN 6.65 11/03/28 GMTN	430	0	0	430 USD	5.75%	24'725.00	0.01	a)
XS1318576086	9.5000 % ANGOL 9 1/2 11/12/25 REGS	500	0	0	500 USD	99.90%	499'520.00	0.12	a)
XS1319820897	6.8750 % SGCAZE 6 7/8 03/24/26 REGS	1'000	200	0	1'200 USD	101.23%	1'214'760.00	0.28	a)
XS1324931895	7.0000 % BHRAIN 7 01/26/26 REGS	400	400	0	800 USD	100.80%	806'376.00	0.19	a)
XS1395523779	2.8750 % EXIMCH 2 7/8 04/26/26	200	0	0	200 USD	96.07%	192'132.00	0.04	a)
XS1396347566	6.6500 % LEBAN 6.65 04/22/24	200	0	0	200 USD	5.75%	11'500.00	0.00	a)
XS1402929746	3.1250 % ADGB 3 1/8 05/03/26 REGS	400	200	0	600 USD	96.41%	578'454.00	0.13	a)
XS1405766541	7.0000 % BHRAIN 7 10/12/28 REGS	600	250	0	850 USD	102.34%	869'921.88	0.20	a)
XS1405770220	5.7500 % JORDAN 5 3/4 01/31/27 REGS	400	200	0	600 USD	96.46%	578'736.00	0.13	a)
XS1405770733	5.6240 % BHRAIN 5.624 02/12/24 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1405777589	4.7500 % OMAN 4 3/4 06/15/26 REGS	800	450	0	1'250 USD	97.93%	1'224'150.00	0.28	a)
XS1405781854	4.6250 % QATAR 4 5/8 06/02/46 REGS	400	200	0	600 USD	91.23%	547'356.00	0.13	a)
XS1405782159	3.2500 % QATAR 3 1/4 06/02/26 REGS	800	400	0	1'200 USD	96.63%	1'159'500.00	0.27	a)
XS1422334448	3.0000 % SDBC 3 06/01/26 EMTN	200	0	0	200 USD	95.94%	191'884.00	0.04	a)
XS1450332256	4.2000 % MINMET 4.2 07/27/26	200	0	0	200 USD	97.25%	194'504.00	0.05	a)
XS1508675417	3.2500 % KSA 3 1/4 10/26/26 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	95.56%	955'590.00	0.22	a)
XS1508675508	4.5000 % KSA 4 1/2 10/26/46 REGS	1'150	500	200	1'450 USD	83.91%	1'216'640.63	0.28	a)
XS1553212371	4.0000 % SDBC 4 01/24/37 EMTN	200	0	0	200 USD	91.67%	183'338.00	0.04	a)
XS1558078496	8.5000 % EGYPT 8 1/2 01/31/47 REGS	1'000	400	250	1'150 USD	77.52%	891'491.50	0.21	a)
XS1558078736	7.5000 % EGYPT 7 1/2 01/31/27 REGS	800	600	400	1'000 USD	95.41%	954'050.00	0.22	a)
XS1566179039	7.8750 % NGERIA 7 7/8 02/16/32 REGS	800	200	0	1'000 USD	87.89%	878'890.00	0.20	a)
XS1575045338	3.3750 % EXIMCH 3 3/8 03/14/27	200	0	0	200 USD	96.42%	192'840.00	0.04	a)
XS1575967218	5.3750 % OMAN 5 3/8 03/08/27 REGS	680	200	0	880 USD	99.07%	871'824.80	0.20	a)
XS1575968026	6.5000 % OMAN 6 1/2 03/08/47 REGS	800	650	200	1'250 USD	98.59%	1'232'375.00	0.29	a)
XS1577945824	5.2000 % MAZOOON 5.2 11/08/27 REGS	200	0	0	200 USD	98.41%	196'814.00	0.05	a)
XS1577950311	7.3750 % JORDAN 7 3/8 10/10/47 REGS	600	0	0	600 USD	86.13%	516'750.00	0.12	a)
XS1582346968	3.5000 % KUWIB 3 1/2 03/20/27 REGS	2'300	1'000	200	3'100 USD	96.84%	3'001'916.00	0.70	a)
XS1586230051	6.8500 % LEBAN 6.85 03/23/27	620	0	0	620 USD	5.75%	35'650.00	0.01	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 USD	in % 7)	Kat.
XS1586230309	7.2500 % LEBAN 7 1/4 03/23/37	200	0	0	200 USD	5.75%	11'500.00	0.00	a)
XS1586230481	7.0000 % LEBAN 7 03/23/32 15YR	480	0	0	480 USD	5.75%	27'600.00	0.01	a)
XS1596070547	3.0000 % MUBAUH 3 04/19/24 GMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1599284202	3.6280 % KSA 3.628 04/20/27 REGS	800	200	0	1'000 USD	96.18%	961'770.00	0.22	a)
XS1619155564	6.2500 % SENEGL 6 1/4 05/23/33 REGS	600	200	0	800 USD	83.25%	666'000.00	0.15	a)
XS1620176831	4.3970 % OMANGS 4.397 06/01/24 REGS	850	0	850	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1631415400	6.1250 % IVYCST 6 1/8 06/15/33 REGS	650	200	0	850 USD	87.72%	745'620.00	0.17	a)
XS1644429935	4.1250 % HAOHUA 4 1/8 07/19/27	200	0	0	200 USD	95.95%	191'906.00	0.04	a)
XS1675855073	5.2500 % BHRAIN 5 1/4 03/20/25 REGS	400	200	0	600 USD	98.74%	592'464.00	0.14	a)
XS1675862012	6.7500 % BHRAIN 6 3/4 09/20/29 REGS	400	200	0	600 USD	99.97%	599'812.50	0.14	a)
XS1675862103	7.5000 % BHRAIN 7 1/2 09/20/47 REGS	400	200	0	600 USD	94.05%	564'282.00	0.13	a)
XS1676401414	7.1250 % TAJIKI 7 1/8 09/14/27 REGS	200	200	0	400 USD	90.32%	361'280.00	0.08	a)
XS1678623734	3.5000 % AZERBJ 3 1/2 09/01/32 REGS	550	150	0	700 USD	84.23%	589'617.00	0.14	a)
XS1682544157	4.3750 % KZTGKZ 4 3/8 09/26/27 REGS	400	0	0	400 USD	93.42%	373'684.00	0.09	a)
XS1694217495	3.6250 % KSA 3 5/8 03/04/28 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	95.05%	950'500.00	0.22	a)
XS1694218469	4.6250 % KSA 4 5/8 10/04/47 REGS	800	0	0	800 USD	84.75%	678'000.00	0.16	a)
XS1696892295	3.1250 % ADGB 3 1/8 10/11/27 REGS	600	850	400	1'050 USD	94.78%	995'203.13	0.23	a)
XS1696899035	4.1250 % ADGB 4 1/8 10/11/47 REGS	600	200	200	600 USD	83.50%	501'000.00	0.12	a)
XS1706605281	2.6250 % CHINA 2 5/8 11/02/27	200	0	0	200 USD	94.23%	188'460.00	0.04	a)
XS1709529520	3.6500 % ADNOUN 3.65 11/02/29 REGS	200	0	0	200 USD	93.63%	187'250.00	0.04	a)
XS1709535097	4.6000 % ADNOUN 4.6 11/02/47 REGS	400	200	0	600 USD	89.10%	534'576.00	0.12	a)
XS1717011982	6.5000 % NGERIA 6 1/2 11/28/27 REGS	800	400	200	1'000 USD	90.92%	909'230.00	0.21	a)
XS1717013095	7.6250 % NGERIA 7 5/8 11/28/47 REGS	800	200	0	1'000 USD	77.12%	771'230.00	0.18	a)
XS1717764143	4.0000 % EXIMCH 4 11/28/47 EMTN	200	0	0	200 USD	85.38%	170'750.00	0.04	a)
XS1729875598	6.8750 % PKSTAN 6 7/8 12/05/27 REGS	800	650	450	1'000 USD	76.01%	760'110.00	0.18	a)
XS1750113661	5.6250 % OMAN 5 5/8 01/17/28 REGS	1'000	400	0	1'400 USD	100.00%	1'400'000.00	0.33	a)
XS1750114396	6.7500 % OMAN 6 3/4 01/17/48 REGS	1'000	450	0	1'450 USD	100.57%	1'458'323.00	0.34	a)
XS1775617464	7.9030 % EGYPT 7.903 02/21/48 REGS	400	400	0	800 USD	75.04%	600'352.00	0.14	a)
XS1775618439	6.5880 % EGYPT 6.588 02/21/28 REGS	400	200	0	600 USD	90.00%	540'012.00	0.13	a)
XS1777972511	7.1430 % NGERIA 7.143 02/23/30 REGS	600	200	0	800 USD	88.31%	706'500.00	0.16	a)
XS1777972941	7.6960 % NGERIA 7.696 02/23/38 REGS	600	200	0	800 USD	80.30%	642'360.00	0.15	a)
XS1781710543	7.2500 % KENINT 7 1/4 02/28/28 REGS	400	200	0	600 USD	92.63%	555'750.00	0.13	a)
XS1781710626	8.2500 % KENINT 8 1/4 02/28/48 REGS	600	0	0	600 USD	81.50%	489'000.00	0.11	a)
XS1788513734	5.1250 % HAOHUA 5 1/8 03/14/28	200	400	0	600 USD	98.95%	593'688.00	0.14	a)
XS1788514039	4.8750 % HAOHUA 4 7/8 03/14/25	0	200	0	200 USD	99.04%	198'082.00	0.05	a)
XS1790134362	6.7500 % SENEGL 6 3/4 03/13/48 REGS	600	0	0	600 USD	72.38%	434'250.00	0.10	a)
XS1791326991	4.2260 % SHARSK 4.226 03/14/28 EMTN	200	0	0	200 USD	95.43%	190'862.00	0.04	a)
XS1791937441	4.0000 % KSA 4 04/17/25 REGS	800	0	0	800 USD	98.36%	786'856.00	0.18	a)
XS1791939066	4.5000 % KSA 4 1/2 04/17/30 REGS	600	0	0	600 USD	97.06%	582'360.00	0.14	a)
XS1791939736	5.0000 % KSA 5 04/17/49 REGS	600	200	200	600 USD	88.90%	533'412.00	0.12	a)
XS1799523276	5.9320 % OMANGS 5.932 10/31/25 REGS	600	200	0	800 USD	100.34%	802'752.00	0.19	a)
XS1802362951	6.8750 % BHRAIN 6 7/8 10/05/25 REGS	400	200	0	600 USD	101.13%	606'750.00	0.14	a)
XS1807174393	4.5000 % QATAR 4 1/2 04/23/28 REGS	600	800	500	900 USD	99.63%	896'625.00	0.21	a)
XS1807174559	5.1030 % QATAR 5.103 04/23/48 REGS	1'400	450	0	1'850 USD	96.31%	1'781'661.00	0.41	a)
XS1814962582	6.1250 % EXCRTU 6 1/8 05/03/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1819680288	8.2500 % ANGOL 8 1/4 05/09/28 REGS	800	400	0	1'200 USD	92.10%	1'105'164.00	0.26	a)
XS1819680528	9.3750 % ANGOL 9 3/8 05/08/48 REGS	800	650	200	1'250 USD	81.88%	1'023'500.00	0.24	a)
XS1821416234	7.6250 % GHANA 7 5/8 05/16/29 REGS	600	0	0	600 USD	42.38%	254'250.00	0.06	a)
XS1821416408	8.6270 % GHANA 8.627 06/16/49 REGS	450	0	0	450 USD	41.63%	187'312.50	0.04	a)
XS1837994794	5.1250 % ROMANI 5 1/8 06/15/48 REGS	650	150	0	800 USD	82.93%	663'432.00	0.15	a)
XS1843435766	8.0000 % KENINT 8 05/22/32 REGS	600	200	200	600 USD	90.25%	541'500.00	0.13	a)
XS1843435840	7.0000 % KENINT 7 05/22/27 REGS	400	200	0	600 USD	95.85%	575'082.00	0.13	a)
XS1864522757	8.4500 % ESKOM 8.45 08/10/28 REGS	200	0	0	200 USD	99.35%	198'700.00	0.05	a)
XS1864523300	6.3500 % ESKOM 6.35 08/10/28 REGS	400	400	200	600 USD	95.66%	573'972.00	0.13	a)
XS1881581968	4.3030 % KSA 4.303 01/19/29 REGS	400	0	0	400 USD	97.41%	389'624.00	0.09	a)
XS1883879006	5.6250 % DPWDU 5 5/8 09/25/48 REGS	200	0	0	200 USD	93.66%	187'312.50	0.04	a)
XS1883963990	4.8480 % DPWDU 4.848 09/26/28 REGS	200	200	0	400 USD	98.32%	393'268.00	0.09	a)
XS1891574441	3.5000 % CHINA 3 1/2 10/19/28	200	0	0	200 USD	96.83%	193'654.00	0.05	a)
XS1891577030	4.0000 % CHINA 4 10/19/48	200	0	0	200 USD	90.52%	181'048.00	0.04	a)
XS1901860160	7.6250 % OILGAS 7 5/8 11/07/24 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1903485800	8.3750 % OILGAS 8 3/8 11/07/28 REGS	200	0	0	200 USD	107.68%	215'352.00	0.05	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 USD	in % 7)	Kat.
XS1904648570	4.5000 % MUBAUH 4 1/2 11/07/28 REGS	200	0	0	200 USD	98.10%	196'198.00	0.05	a)
XS1910826996	7.6250 % NGERIA 7 5/8 11/21/25 REGS	400	650	400	650 USD	98.41%	639'640.63	0.15	a)
XS1910827887	8.7470 % NGERIA 8.747 01/21/31 REGS	400	450	200	650 USD	94.18%	612'150.50	0.14	a)
XS1910828182	9.2480 % NGERIA 9.248 01/21/49 REGS	400	0	0	400 USD	90.24%	360'944.00	0.08	a)
XS1917720911	8.2500 % EXCRTU 8 1/4 01/24/24 REGS	0	200	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1936302865	4.3750 % KSA 4 3/8 04/16/29 REGS	800	0	0	800 USD	97.13%	777'024.00	0.18	a)
XS1936302949	5.2500 % KSA 5 1/4 01/16/50 REGS	600	200	0	800 USD	92.00%	736'000.00	0.17	a)
XS1944412664	4.8750 % OMAN 4 7/8 02/01/25 REGS	400	400	200	600 USD	98.84%	593'010.00	0.14	a)
XS1944412748	6.0000 % OMAN 6 08/01/29 REGS	800	850	400	1'250 USD	101.44%	1'267'968.75	0.29	a)
XS1953055875	6.2004 % EGYPT 6.2004 03/01/24 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1953057061	7.6000 % EGYPT 7.6003 03/01/29 REGS	600	850	650	800 USD	90.64%	725'104.00	0.17	a)
XS1953057491	8.7002 % EGYPT 8.7002 03/01/49 REGS	400	750	300	850 USD	78.83%	670'063.50	0.16	a)
XS1953255616	5.6250 % MUMTAK 5 5/8 02/27/24	200	200	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1953915136	5.3750 % UZBEK 5 3/8 02/20/29 REGS	200	200	0	400 USD	94.07%	376'292.00	0.09	a)
XS1953916290	4.7500 % UZBEK 4 3/4 02/20/24 REGS	200	200	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1959337236	3.3750 % QATAR 3 3/8 03/14/24 REGS	400	200	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1959337582	4.0000 % QATAR 4 03/14/29 REGS	800	450	0	1'250 USD	97.38%	1'217'187.50	0.28	a)
XS1959337749	4.8170 % QATAR 4.817 03/14/49 REGS	1'200	1'080	200	2'080 USD	92.52%	1'924'374.40	0.45	a)
XS1968714110	7.8750 % GHANA 7 7/8 03/26/27 REGS	400	200	0	600 USD	43.50%	261'000.00	0.06	a)
XS1968714540	8.1250 % GHANA 8 1/8 03/26/32 REGS	650	250	0	900 USD	42.72%	384'435.00	0.09	a)
XS1968714623	8.9500 % GHANA 8.95 03/26/51 REGS	450	200	0	650 USD	42.64%	277'160.00	0.06	a)
XS1969593356	3.8540 % SHARSK 3.854 04/03/26 EMTN	200	0	0	200 USD	96.67%	193'332.00	0.04	a)
XS1989704843	3.2500 % SDIC 3 1/4 05/21/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1989705063	3.7500 % SDIC 3 3/4 05/21/29 EMTN	0	200	0	200 USD	94.68%	189'352.00	0.04	a)
XS2010026305	5.2500 % REPHUN 5 1/4 06/16/29 REGS	950	400	200	1'150 USD	98.17%	1'128'932.00	0.26	a)
XS2010026487	5.5000 % REPHUN 5 1/2 06/16/34 REGS	600	200	0	800 USD	97.28%	778'224.00	0.18	a)
XS2010026727	4.7500 % UNGUZB 4 3/4 11/16/28 REGS	400	0	0	400 USD	84.44%	337'760.00	0.08	a)
XS2010027709	4.3140 % ESKOM 4.314 07/23/27	200	0	0	200 USD	91.84%	183'682.00	0.04	a)
XS2010028939	3.6000 % ARMEN 3.6 02/02/31 REGS	550	0	0	550 USD	80.91%	445'021.50	0.10	a)
XS2010043904	3.9500 % ARMEN 3.95 09/26/29 REGS	200	0	0	200 USD	85.91%	171'816.00	0.04	a)
XS2011969651	3.3750 % HAOHUA 3 3/8 06/19/24	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2011969735	3.8750 % HAOHUA 3 7/8 06/19/29	200	0	0	200 USD	92.85%	185'704.00	0.04	a)
XS2026710553	3.8750 % DPWDU 3 7/8 07/18/29 EMTN	200	0	0	200 USD	93.52%	187'044.00	0.04	a)
XS2051055908	4.1000 % CHALUM 4.1 PERP	200	0	0	200 USD	98.96%	197'926.00	0.05	a)
XS2051203862	9.0000 % MOZAM 9 09/15/31 REGS	400	200	0	600 USD	83.86%	503'172.00	0.12	a)
XS2056707420	3.7495 % DPWDU 3.7495 01/30/30 REGS	0	200	0	200 USD	92.32%	184'644.00	0.04	a)
XS2056719359	4.7000 % DPWDU 4.7 09/30/49 REGS	200	0	0	200 USD	81.47%	162'938.00	0.04	a)
XS2057865896	2.1250 % ADGB 2 1/8 09/30/24 REGS	400	200	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2057865979	2.5000 % ADGB 2 1/2 09/30/29 REGS	600	200	0	800 USD	89.23%	713'864.00	0.17	a)
XS2057866191	3.1250 % ADGB 3 1/8 09/30/49 REGS	600	200	0	800 USD	69.42%	555'392.00	0.13	a)
XS2058943734	4.5000 % BHRAIN 4 1/2 03/30/27 REGS	400	200	0	600 USD	96.37%	578'202.00	0.13	a)
XS2058948451	5.6250 % BHRAIN 5 5/8 09/30/31 REGS	450	400	200	650 USD	93.00%	604'500.00	0.14	a)
XS2067187810	3.2340 % SHARSK 3.234 10/23/29	200	0	0	200 USD	89.40%	178'798.00	0.04	a)
XS2072816114	2.9690 % KSA 2.969 10/29/29 REGS	400	200	0	600 USD	90.14%	540'852.00	0.13	a)
XS2075921887	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 11/07/24 REGS	200	0	0	200 USD	97.72%	195'437.50	0.05	a)
XS2075923313	2.8750 % MUBAUH 2 7/8 11/07/29 REGS	200	0	0	200 USD	89.81%	179'625.00	0.04	a)
XS2075924048	3.7000 % MUBAUH 3.7 11/07/49 REGS	200	200	0	400 USD	75.56%	302'250.00	0.07	a)
XS2079842642	7.0529 % EGYPT 7.0529 01/15/32 REGS	400	400	200	600 USD	82.78%	496'680.00	0.12	a)
XS2079846635	8.1500 % EGYPT 8.15 11/20/59 REGS	200	0	0	200 USD	75.38%	150'756.00	0.04	a)
XS2080205797	2.6000 % HUANEN 2.6 12/10/24	200	0	0	200 USD	97.78%	195'552.00	0.05	a)
XS2080206092	3.0000 % HUANEN 3 12/10/29	200	0	0	200 USD	89.62%	179'242.00	0.04	a)
XS2083302419	8.0000 % ANGOL 8 11/26/29 REGS	900	600	400	1'100 USD	88.95%	978'483.00	0.23	a)
XS2083302500	9.1250 % ANGOL 9 1/8 11/26/49 REGS	600	200	0	800 USD	80.30%	642'424.00	0.15	a)
XS2084424493	1.9500 % CHINA 1.95 12/03/24	200	250	0	450 USD	97.63%	439'321.50	0.10	a)
XS2084425110	2.1250 % CHINA 2 1/8 12/03/29	200	400	0	600 USD	89.32%	535'890.00	0.12	a)
XS2103157991	4.1000 % MUMTAK 4.1 01/21/27	200	0	0	200 USD	94.57%	189'146.00	0.04	a)
XS2109766126	2.5000 % KSA 2 1/2 02/03/27 REGS	200	0	0	200 USD	93.17%	186'340.00	0.04	a)
XS2109766472	2.7500 % KSA 2 3/4 02/03/32 REGS	200	0	0	200 USD	84.81%	169'620.00	0.04	a)
XS2109770151	3.7500 % KSA 3 3/4 01/21/55 REGS	600	0	0	600 USD	70.87%	425'244.00	0.10	a)
XS2113615228	6.6250 % GABON 6 5/8 02/06/31 REGS	600	200	200	600 USD	81.31%	487'878.00	0.11	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 USD	in % 7)	Kat.
XS2115122538	6.3750 % GHANA 6 3/8 02/11/27 REGS	500	400	200	700 USD	43.25%	302'750.00	0.07	a)
XS2115141751	7.8750 % GHANA 7 7/8 02/11/35 REGS	400	200	0	600 USD	42.85%	257'094.00	0.06	a)
XS2115147287	8.7500 % GHANA 8 3/4 03/11/61 REGS	400	0	0	400 USD	42.41%	169'648.00	0.04	a)
XS2116905691	2.1250 % JIANYI 2 1/8 08/27/30	200	0	0	200 USD	83.82%	167'632.00	0.04	a)
XS2125308085	2.5000 % ADGB 2 1/2 04/16/25 REGS	400	200	0	600 USD	97.03%	582'204.00	0.14	a)
XS2125308168	3.1250 % ADGB 3 1/8 04/16/30 REGS	600	0	0	600 USD	91.59%	549'510.00	0.13	a)
XS2125308242	3.8750 % ADGB 3 7/8 04/16/50 REGS	600	400	0	1'000 USD	79.22%	792'160.00	0.18	a)
XS2140041786	3.1250 % CHITRA 3 1/8 04/23/30	200	0	0	200 USD	89.48%	178'956.00	0.04	a)
XS2152902479	1.6250 % CHGRID 1 5/8 08/05/30 EMTN	200	0	0	200 USD	82.89%	165'778.00	0.04	a)
XS2155352151	3.4000 % QATAR 3.4 04/16/25 REGS	400	400	200	600 USD	98.13%	588'786.00	0.14	a)
XS2155352664	3.7500 % QATAR 3 3/4 04/16/30 REGS	700	200	0	900 USD	95.63%	860'625.00	0.20	a)
XS2155352748	4.4000 % QATAR 4.4 04/16/50 REGS	1'200	400	0	1'600 USD	87.29%	1'396'608.00	0.32	a)
XS2158697255	6.0000 % DPWDU 6 PERP	200	0	0	200 USD	99.61%	199'224.00	0.05	a)
XS2159975619	2.9000 % KSA 2.9 10/22/25 REGS	400	600	600	400 USD	96.20%	384'800.00	0.09	a)
XS2159975700	3.2500 % KSA 3 1/4 10/22/30 REGS	200	600	500	300 USD	89.78%	269'343.75	0.06	a)
XS2159975882	4.5000 % KSA 4 1/2 04/22/60 REGS	600	0	0	600 USD	80.88%	485'250.00	0.11	a)
XS2172964715	6.2500 % BHRAIN 6 1/4 11/14/24 REGS	450	0	0	450 USD	99.68%	448'555.50	0.10	a)
XS2172965282	7.3750 % BHRAIN 7 3/8 05/14/30 REGS	400	200	0	600 USD	103.02%	618'090.00	0.14	a)
XS2175968580	3.9500 % MUBAUH 3.95 05/21/50 GMTN	400	0	0	400 USD	78.50%	314'000.00	0.07	a)
XS2176018609	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 05/21/26 GMTN	200	0	0	200 USD	94.12%	188'236.00	0.04	a)
XS2176021223	2.8750 % MUBAUH 2 7/8 05/21/30 GMTN	200	0	0	200 USD	88.77%	177'530.00	0.04	a)
XS2176895469	5.7500 % EGYPT 5 3/4 05/29/24 REGS	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2176897754	7.6250 % EGYPT 7 5/8 05/29/32 REGS	600	400	200	800 USD	85.18%	681'408.00	0.16	a)
XS2176899701	8.8750 % EGYPT 8 7/8 05/29/50 REGS	800	200	0	1'000 USD	79.97%	799'887.50	0.19	a)
XS2179917906	1.3500 % CNPCC 1.35 06/23/25	200	0	0	200 USD	94.87%	189'736.00	0.04	a)
XS2182820329	2.9420 % SHARSK 2.942 06/10/27	200	0	0	200 USD	92.48%	184'956.00	0.04	a)
XS2184856859	3.3750 % HUADIA 3 3/8 PERP	200	0	0	200 USD	97.15%	194'290.00	0.05	a)
XS2199272662	5.8500 % JORDAN 5.85 07/07/30 REGS	630	400	200	830 USD	90.25%	749'075.00	0.17	a)
XS2199321113	4.9500 % JORDAN 4.95 07/07/25 REGS	200	200	0	400 USD	97.25%	388'980.00	0.09	a)
XS2201851172	3.0000 % ROMANI 3 02/14/31 REGS	680	100	0	780 USD	83.28%	649'560.60	0.15	a)
XS2201851685	4.0000 % ROMANI 4 02/14/51 REGS	970	390	100	1'260 USD	69.32%	873'369.00	0.20	a)
XS2207514063	4.0000 % SHJGOV 4 07/28/50 REGS	200	0	0	200 USD	63.40%	126'792.00	0.03	a)
XS2208275854	1.6250 % POWINV 1 5/8 07/27/25 EMTN	200	0	0	200 USD	94.78%	189'550.00	0.04	a)
XS2214237807	6.0000 % ECUA 6 07/31/30 REGS	1'867	500	140	2'227 USD	61.11%	1'361'052.77	0.32	a)
XS2214238441	3.5000 % ECUA 3 1/2 07/31/35 REGS	4'208	1'460	900	4'768 USD	47.69%	2'273'811.53	0.53	a)
XS2214239175	2.5000 % ECUA 2 1/2 07/31/40 REGS	1'740	150	0	1'890 USD	43.72%	826'266.01	0.19	a)
XS2214239506	0.0000 % ECUA 0 07/31/30 REGS	512	0	0	512 USD	40.53%	207'637.54	0.05	a)
XS2225210330	2.7000 % ADGB 2.7 09/02/70 REGS	400	0	0	400 USD	57.92%	231'664.00	0.05	a)
XS2225210413	1.7000 % ADGB 1.7 03/02/31 REGS	200	200	0	400 USD	82.46%	329'856.00	0.08	a)
XS2226808082	2.0000 % HAOHUA 2 09/22/25	200	0	0	200 USD	94.42%	188'838.00	0.04	a)
XS2226808165	3.0000 % HAOHUA 3 09/22/30	200	0	0	200 USD	86.69%	173'372.00	0.04	a)
XS2226916216	5.4500 % BHRAIN 5.45 09/16/32 REGS	400	200	0	600 USD	90.34%	542'062.50	0.13	a)
XS2226917701	3.9500 % BHRAIN 3.95 09/16/27 REGS	400	400	200	600 USD	94.28%	565'687.50	0.13	a)
XS2226973522	3.9000 % DUGB 3.9 09/09/50 EMTN	200	0	0	200 USD	73.89%	147'778.00	0.03	a)
XS2234859101	6.7500 % OMAN 6 3/4 10/28/27 REGS	600	400	200	800 USD	103.57%	828'584.00	0.19	a)
XS2234859283	7.3750 % OMAN 7 3/8 10/28/32 REGS	400	200	0	600 USD	109.91%	659'437.50	0.15	a)
XS2237806281	2.2000 % COFCHK 2.2 10/21/30	200	0	0	200 USD	83.41%	166'820.00	0.04	a)
XS2237806364	3.1000 % COFCHK 3.1 PERP	0	200	0	200 USD	96.45%	192'898.00	0.04	a)
XS2241075014	5.2500 % EGYPT 5 1/4 10/06/25 REGS	200	200	0	400 USD	95.73%	382'904.00	0.09	a)
XS2244843210	3.0800 % HUANEN 3.08 PERP	0	200	0	200 USD	95.86%	191'714.00	0.04	a)
XS2245508044	2.3940 % UNITYL 2.394 11/03/25 EMTN	200	0	0	200 USD	94.94%	189'880.00	0.04	a)
XS2247216174	1.0000 % SDBC 1 10/27/25 EMTN	200	0	0	200 USD	93.49%	186'974.00	0.04	a)
XS2247216257	1.6250 % SDBC 1 5/8 10/27/30 EMTN	0	200	0	200 USD	82.61%	165'218.00	0.04	a)
XS2247703163	2.7000 % HUANEN 2.7 01/20/31	200	0	0	200 USD	85.94%	171'884.00	0.04	a)
XS2248458395	5.1250 % OMAOIL 5 1/8 05/06/28 REGS	250	200	0	450 USD	97.47%	438'624.00	0.10	a)
XS2249462016	1.6250 % SINOCH 1 5/8 10/29/25 EMTN	0	200	0	200 USD	93.64%	187'270.00	0.04	a)
XS2262220143	3.7500 % DUBAEE 3 3/4 02/15/26 REGS	0	200	0	200 USD	96.49%	192'970.00	0.04	a)
XS2263765856	3.7000 % UZBEK 3.7 11/25/30 REGS	400	0	0	400 USD	83.05%	332'184.00	0.08	a)
XS2264555744	2.1250 % SERBIA 2 1/8 12/01/30 REGS	600	0	0	600 USD	78.86%	473'154.00	0.11	a)
XS2269194499	3.0800 % CHPWCN 3.08 PERP	200	0	0	200 USD	94.83%	189'650.00	0.04	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 USD	in % 7)	Kat.
XS2270576619	2.3750 % MOROC 2 3/8 12/15/27 REGS	300	200	0	500 USD	88.93%	444'650.00	0.10	a)
XS2270576965	3.0000 % MOROC 3 12/15/32 REGS	600	0	0	600 USD	79.57%	477'408.00	0.11	a)
XS2270577344	4.0000 % MOROC 4 12/15/50 REGS	700	0	0	700 USD	67.47%	472'281.25	0.11	a)
XS2274089288	5.3750 % TCZIRA 5 3/8 03/02/26 REGS	200	0	0	200 USD	97.27%	194'548.00	0.05	a)
XS2279124130	0.6250 % SDBC 0 5/8 01/12/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2280637039	3.7500 % MEX 3 3/4 04/19/2071	400	200	0	600 USD	63.03%	378'180.00	0.09	a)
XS2286303495	3.3750 % DUBAEE 3 3/8 03/20/28 REGS	200	0	0	200 USD	91.92%	183'836.00	0.04	a)
XS2288905370	6.2500 % OMAN 6 1/4 01/25/31 REGS	600	200	0	800 USD	102.47%	819'750.00	0.19	a)
XS2288906857	7.0000 % OMAN 7 01/25/51 REGS	400	200	0	600 USD	103.73%	622'368.00	0.14	a)
XS2290956924	4.2500 % BHRAIN 4 1/4 01/25/28 REGS	200	200	0	400 USD	92.59%	370'340.00	0.09	a)
XS2290957146	5.2500 % BHRAIN 5 1/4 01/25/33 REGS	400	400	200	600 USD	87.78%	526'687.50	0.12	a)
XS2290957732	6.2500 % BHRAIN 6 1/4 01/25/51 REGS	200	200	0	400 USD	80.88%	323'500.00	0.08	a)
XS2294322818	2.2500 % KSA 2 1/4 02/02/33 REGS	600	200	200	600 USD	79.50%	477'000.00	0.11	a)
XS2294323386	3.4500 % KSA 3.45 02/02/61 REGS	520	200	400	320 USD	65.48%	209'526.40	0.05	a)
XS2297220423	3.8750 % EGYPT 3 7/8 02/16/26 REGS	200	600	400	400 USD	92.07%	368'288.00	0.09	a)
XS2297221405	7.5000 % EGYPT 7 1/2 02/16/61 REGS	650	200	0	850 USD	70.92%	602'837.00	0.14	a)
XS2297226545	5.8750 % EGYPT 5 7/8 02/16/31 REGS	500	200	0	700 USD	80.51%	563'549.00	0.13	a)
XS2302929810	3.6250 % SHJGOV 3 5/8 03/10/33 REGS	0	200	0	200 USD	82.87%	165'748.00	0.04	a)
XS2302929901	4.3750 % SHJGOV 4 3/8 03/10/51 REGS	200	0	0	200 USD	68.01%	136'026.00	0.03	a)
XS2322319398	6.0000 % PKSTAN 6 04/08/26 REGS	640	300	200	740 USD	79.51%	588'381.40	0.14	a)
XS2322319638	7.3750 % PKSTAN 7 3/8 04/08/31 REGS	640	650	200	1'090 USD	70.01%	763'119.90	0.18	a)
XS2322321964	8.8750 % PKSTAN 8 7/8 04/08/51 REGS	420	0	0	420 USD	66.28%	278'355.00	0.06	a)
XS2324826994	3.4000 % MUBAUH 3.4 06/07/51 EMTN	200	0	0	200 USD	70.91%	141'818.00	0.03	a)
XS2325742166	0.0000 % GHANA 0 04/07/25 REGS	200	0	0	200 USD	35.43%	70'858.00	0.02	a)
XS2325747397	8.6250 % GHANA 8 5/8 04/07/34 REGS	420	200	0	620 USD	42.92%	266'110.20	0.06	a)
XS2325747637	8.8750 % GHANA 8 7/8 05/07/42 REGS	400	0	0	400 USD	42.46%	169'828.00	0.04	a)
XS2325748106	7.7500 % GHANA 7 3/4 04/07/29 REGS	400	400	300	500 USD	42.75%	213'750.00	0.05	a)
XS2327851874	3.5000 % CHILE 3 1/2 04/15/53	400	0	0	400 USD	72.24%	288'940.00	0.07	a)
XS2328888149	5.2500 % OILGAS 5 1/4 04/08/29 REGS	250	200	0	450 USD	96.53%	434'390.63	0.10	a)
XS2332876106	5.7500 % EXCRTU 5 3/4 07/06/26 REGS	200	0	0	200 USD	97.34%	194'687.50	0.05	a)
XS2334109423	2.7500 % GEORG 2 3/4 04/22/26 REGS	200	0	0	200 USD	92.93%	185'854.00	0.04	a)
XS2340059794	2.1250 % CHALUM 2 1/8 06/03/26	200	0	0	200 USD	92.93%	185'850.00	0.04	a)
XS2340149439	4.0000 % GRAIL 4 06/17/28 REGS	400	0	0	400 USD	90.71%	362'832.00	0.08	a)
XS2348236980	1.6250 % ADGB 1 5/8 06/02/28 REGS	200	200	0	400 USD	88.11%	352'424.00	0.08	a)
XS2348591707	7.5000 % PAKWNP 7 1/2 06/04/31	200	200	0	400 USD	60.06%	240'250.00	0.06	a)
XS2348658035	2.5000 % MUBAUH 2 1/2 06/03/31 GMTN	200	0	0	200 USD	85.13%	170'264.00	0.04	a)
XS2351109116	5.1250 % TURKSK 5 1/8 06/22/26 REGS	400	200	0	600 USD	96.60%	579'570.00	0.13	a)
XS2351310482	4.8750 % OMANGS 4 7/8 06/15/30 REGS	600	400	0	1'000 USD	97.80%	978'010.00	0.23	a)
XS2352309681	1.6390 % EMDEBK 1.639 06/15/26 EMTN	200	0	0	200 USD	91.98%	183'966.00	0.04	a)
XS2354781614	6.3000 % KENINT 6.3 01/23/34 REGS	400	200	0	600 USD	78.50%	471'000.00	0.11	a)
XS2356380373	1.5500 % DUBAEE 1.55 08/01/24 REGS	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2357493860	1.3750 % QPETRO 1 3/8 09/12/26 REGS	400	0	0	400 USD	91.41%	365'625.00	0.09	a)
XS2357494322	2.2500 % QPETRO 2 1/4 07/12/31 REGS	800	400	0	1'200 USD	83.31%	999'696.00	0.23	a)
XS2357494751	3.3000 % QPETRO 3.3 07/12/51 REGS	1'000	400	0	1'400 USD	69.49%	972'804.00	0.23	a)
XS2358712896	3.2000 % SHARSK 3.2 07/13/31	200	0	0	200 USD	85.73%	171'452.00	0.04	a)
XS2359548935	3.1250 % QPETRO 3 1/8 07/12/41 REGS	750	400	0	1'150 USD	73.56%	845'963.00	0.20	a)
XS2365195978	3.9000 % UZBEK 3.9 10/19/31 REGS	250	200	0	450 USD	82.30%	370'336.50	0.09	a)
XS2373051320	5.5000 % RWANDA 5 1/2 08/09/31 REGS	300	0	0	300 USD	80.96%	242'871.00	0.06	a)
XS2380541685	0.6250 % SDBC 0 5/8 09/09/24 EMTN	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
XS2384698994	6.1250 % NGERIA 6 1/8 09/28/28 REGS	500	250	0	750 USD	87.85%	658'852.50	0.15	a)
XS2384701020	7.3750 % NGERIA 7 3/8 09/28/33 REGS	650	650	200	1'100 USD	83.78%	921'525.00	0.21	a)
XS2384704800	8.2500 % NGERIA 8 1/4 09/28/51 REGS	650	400	200	850 USD	81.26%	690'727.00	0.16	a)
XS2386638733	1.8750 % ADGB 1 7/8 09/15/31 REGS	200	200	0	400 USD	82.44%	329'750.00	0.08	a)
XS2386638816	3.0000 % ADGB 3 09/15/51 REGS	200	0	0	200 USD	66.96%	133'928.00	0.03	a)
XS2387357341	1.5000 % SINOCH 1 1/2 09/23/26 EMTN	200	0	0	200 USD	90.49%	180'986.00	0.04	a)
XS2388586401	2.1250 % REPHUN 2 1/8 09/22/31 REGS	1'150	450	200	1'400 USD	78.17%	1'094'310.00	0.25	a)
XS2388586583	3.1250 % REPHUN 3 1/8 09/21/51 REGS	1'050	600	200	1'450 USD	62.26%	902'755.50	0.21	a)
XS2391394348	5.8000 % EGYPT 5.8 09/30/27 REGS	400	200	0	600 USD	89.08%	534'474.00	0.12	a)
XS2391395154	7.3000 % EGYPT 7.3 09/30/33 REGS	400	200	0	600 USD	81.58%	489'474.00	0.11	a)
XS2391398174	8.7500 % EGYPT 8 3/4 09/30/51 REGS	200	200	0	400 USD	78.89%	315'572.00	0.07	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 USD	in % 7)	Kat.
XS2395576437	9.3750 % EXCRTU 9 3/8 01/31/26 REGS	0	200	0	200 USD	104.72%	209'430.00	0.05	a)
XS2397053757	2.0000 % UAE 2 10/19/31 REGS	200	0	0	200 USD	83.05%	166'104.00	0.04	a)
XS2397055703	3.2500 % UAE 3 1/4 10/19/61 REGS	300	200	0	500 USD	67.72%	338'590.00	0.08	a)
XS2397083820	2.8750 % UAE 2 7/8 10/19/41 REGS	200	0	0	200 USD	72.66%	145'324.00	0.03	a)
XS2399149694	2.0000 % SAMRUK 2 10/28/26 REGS	200	200	0	400 USD	91.66%	366'652.00	0.09	a)
XS2407752711	7.0000 % GABON 7 11/24/31 REGS	350	0	0	350 USD	81.50%	285'250.00	0.07	a)
XS2408001365	2.2500 % SINOCH 2 1/4 11/24/26 EMTN	200	0	0	200 USD	91.60%	183'208.00	0.04	a)
XS2408002769	3.8750 % BHRAIN 3 7/8 05/18/29 REGS	400	200	0	600 USD	90.90%	545'376.00	0.13	a)
XS2408003064	5.6250 % BHRAIN 5 5/8 05/18/34 REGS	400	200	0	600 USD	88.89%	533'358.00	0.12	a)
XS2408477797	2.2500 % KSA 2 1/4 05/17/31 REGS	400	0	0	400 USD	83.25%	333'000.00	0.08	a)
XS2408613136	3.2500 % KSA 3 1/4 11/17/51 REGS	200	0	0	200 USD	66.26%	132'510.00	0.03	a)
XS2419405274	7.9500 % PKSTAN 7.95 01/31/29 REGS	500	0	0	500 USD	84.65%	423'225.00	0.10	a)
XS2434895988	3.0000 % ROMANI 3 02/27/27 REGS	600	350	0	950 USD	92.81%	881'714.00	0.21	a)
XS2434896010	3.6250 % ROMANI 3 5/8 03/27/32 REGS	540	200	0	740 USD	84.56%	625'751.40	0.15	a)
XS2441287773	7.2500 % TURKSK 7 1/4 02/24/27 REGS	500	200	0	700 USD	101.11%	707'756.00	0.16	a)
XS2445169985	8.3750 % NGERIA 8 3/8 03/24/29 REGS	600	800	500	900 USD	94.77%	852'939.00	0.20	a)
XS2446175577	8.7500 % ANGOL 8 3/4 04/14/32 REGS	800	400	0	1'200 USD	87.86%	1'054'320.00	0.25	a)
XS2455411558	4.2500 % CHPWCN 4 1/4 PERP	200	0	0	200 USD	96.56%	193'124.00	0.04	a)
XS2455984679	3.3750 % MUBAUH 3 3/8 03/28/32 GMTN	200	0	0	200 USD	89.44%	178'882.00	0.04	a)
XS2455985569	3.0000 % MUBAUH 3 03/28/27 GMTN	0	400	200	200 USD	94.01%	188'020.00	0.04	a)
XS2457678469	3.8860 % SHARSK 3.886 04/04/30	0	200	0	200 USD	91.46%	182'912.00	0.04	a)
XS2460254282	3.1250 % CHGRID 3 1/8 04/07/25	200	0	0	200 USD	97.68%	195'358.00	0.05	a)
XS2472852610	5.7500 % DBKAZ 5 3/4 05/12/25 REGS	200	200	0	400 USD	99.94%	399'752.00	0.09	a)
XS2485248806	5.2500 % ROMANI 5 1/4 11/25/27 REGS	550	100	0	650 USD	97.90%	636'376.00	0.15	a)
XS2485249523	6.0000 % ROMANI 6 05/25/34 REGS	600	100	0	700 USD	97.56%	682'927.00	0.16	a)
XS2490731721	7.7500 % JORDAN 7 3/4 01/15/28 REGS	200	200	0	400 USD	101.05%	404'196.00	0.09	a)
XS2492384818	4.0500 % UAE 4.05 07/07/32 REGS	250	600	400	450 USD	95.81%	431'145.00	0.10	a)
XS2492385203	4.9510 % UAE 4.951 07/07/52 REGS	300	0	0	300 USD	94.11%	282'315.00	0.07	a)
XS2523929474	9.7580 % TURKSK 9.758 11/13/25 REGS	450	200	0	650 USD	105.43%	685'295.00	0.16	a)
XS2530049837	10.8750 % EGYSK 10 7/8 02/28/26 REGS	0	850	0	850 USD	105.16%	893'828.13	0.21	a)
XS2542162248	5.2500 % PIFKSA 5 1/4 10/13/32	200	200	0	400 USD	99.88%	399'500.00	0.09	a)
XS2542162321	5.0000 % PIFKSA 5 10/13/27	200	0	0	200 USD	99.39%	198'786.00	0.05	a)
XS2542162677	5.3750 % PIFKSA 5 3/8 10/13/2122	0	200	0	200 USD	84.31%	168'626.00	0.04	a)
XS2546781985	5.5000 % MUBAUH 5 1/2 04/28/33 REGS	0	200	0	200 USD	103.15%	206'308.00	0.05	a)
XS2548889406	5.2680 % KSA 5.268 10/25/28 REGS	300	200	0	500 USD	101.67%	508'330.00	0.12	a)
XS2548892020	5.5000 % KSA 5 1/2 10/25/32 REGS	500	0	0	500 USD	102.63%	513'125.00	0.12	a)
XS2571922884	6.6250 % ROMANI 6 5/8 02/17/28 REGS	300	750	0	1'050 USD	102.96%	1'081'090.50	0.25	a)
XS2571923007	7.1250 % ROMANI 7 1/8 01/17/33 REGS	650	430	100	980 USD	105.36%	1'032'567.20	0.24	a)
XS2571924070	7.6250 % ROMANI 7 5/8 01/17/53 REGS	620	200	0	820 USD	109.04%	894'103.40	0.21	a)
XS2574267188	6.1250 % REPHUN 6 1/8 05/22/28 REGS	550	900	0	1'450 USD	102.06%	1'479'841.00	0.34	a)
XS2574267261	6.2500 % REPHUN 6 1/4 09/22/32 REGS	700	450	0	1'150 USD	103.16%	1'186'328.50	0.28	a)
XS2574267345	6.7500 % REPHUN 6 3/4 09/25/52 REGS	600	200	0	800 USD	106.11%	848'912.00	0.20	a)
XS2577134401	4.7500 % KSA 4 3/4 01/18/28 REGS	0	900	200	700 USD	99.20%	694'400.00	0.16	a)
XS2577135127	4.8750 % KSA 4 7/8 07/18/33 REGS	0	700	0	700 USD	97.75%	684'250.00	0.16	a)
XS2577136109	5.0000 % KSA 5 01/18/53 REGS	0	600	0	600 USD	88.20%	529'194.00	0.12	a)
XS2580269426	6.2500 % SERBIA 6 1/4 05/26/28 REGS	350	400	200	550 USD	101.56%	558'596.50	0.13	a)
XS2580270275	6.5000 % SERBIA 6 1/2 09/26/33 REGS	500	200	0	700 USD	101.70%	711'900.00	0.17	a)
XS2582981952	8.2500 % SAFTRA 8 1/4 02/06/28 REGS	0	650	0	650 USD	99.44%	646'343.75	0.15	a)
XS2585987683	4.7500 % PIFKSA 4 3/4 02/14/30	0	500	200	300 USD	96.88%	290'625.00	0.07	a)
XS2585988061	4.8750 % PIFKSA 4 7/8 02/14/35	0	400	0	400 USD	94.78%	379'125.00	0.09	a)
XS2585988145	5.1250 % PIFKSA 5 1/8 02/14/53	0	250	0	250 USD	85.96%	214'900.00	0.05	a)
XS2587708624	6.5000 % SHJGOV 6 1/2 11/23/32 REGS	0	200	0	200 USD	102.86%	205'712.00	0.05	a)
XS2595028452	5.9500 % MOROC 5.95 03/08/28 REGS	0	850	0	850 USD	100.94%	857'968.75	0.20	a)
XS2595028700	6.5000 % MOROC 6 1/2 09/08/33 REGS	0	950	0	950 USD	102.61%	974'766.50	0.23	a)
XS2602742285	7.5000 % JORDAN 7 1/2 01/13/29 REGS	0	950	0	950 USD	98.63%	936'937.50	0.22	a)
XS2611617619	6.2500 % BHRAIN 6 1/4 10/18/30 REGS	0	600	0	600 USD	101.25%	607'500.00	0.14	a)
XS2611617700	7.7500 % BHRAIN 7 3/4 04/18/35 REGS	0	550	0	550 USD	103.25%	567'875.00	0.13	a)
XS2613748545	3.8750 % EXIMCH 3 7/8 05/16/26 EMTN	0	400	0	400 USD	97.88%	391'508.00	0.09	a)
XS2618838564	6.1250 % MAEXIM 6 1/8 12/04/27 REGS	0	1'000	200	800 USD	100.49%	803'920.00	0.19	a)
XS2621319040	5.3500 % CHILOV 5.35 08/15/33	0	400	0	400 USD	100.64%	402'544.00	0.09	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
XS2623206187	5.0840 % MUBAUH 5.084 05/22/53 REGS	0	200	0	200 USD	94.09%	188'187.50	0.04	a)
XS2624479288	4.3750 % MUBAUH 4 3/8 11/22/33 REGS	0	200	0	200 USD	95.01%	190'020.00	0.04	a)
XS2625207571	5.3750 % BGOSK 5 3/8 05/22/33 REGS	0	1'100	0	1'100 USD	98.84%	1'087'281.25	0.25	a)
XS2626270040	4.2740 % KSA 4.274 05/22/29 REGS	0	600	0	600 USD	96.79%	580'740.00	0.14	a)
XS2626274463	4.5110 % KSA 4.511 05/22/33 REGS	0	600	0	600 USD	96.32%	577'944.00	0.13	a)
XS2627125672	6.6250 % OILGAS 6 5/8 05/25/33	0	400	0	400 USD	103.25%	412'980.00	0.10	a)
XS2629043691	4.8760 % KNBZMK 4.876 06/01/33 EMTN	0	600	0	600 USD	97.85%	587'112.00	0.14	a)
XS2629054201	4.6870 % KNBZMK 4.687 06/01/28 EMTN	0	450	0	450 USD	98.55%	443'457.00	0.10	a)
XS2630760796	6.5000 % MAGYAR 6 1/2 06/29/28	0	700	0	700 USD	101.43%	710'031.00	0.17	a)
XS2634075399	7.5000 % MVMHU 7 1/2 06/09/28	0	500	0	500 USD	103.50%	517'500.00	0.12	a)
XS2677631355	5.5000 % DPWDU 5 1/2 09/13/33	0	400	0	400 USD	100.50%	402'000.00	0.09	a)
XS2680379695	6.0920 % SHARSK 6.092 03/19/34 EMTN	0	200	0	200 USD	103.31%	206'625.00	0.05	a)
XS2684502623	4.9170 % UAE 4.917 09/25/33 REGS	0	300	0	300 USD	101.80%	305'406.00	0.07	a)
XS2689091846	8.5091 % TURKSK 8.5091 01/14/29 REGS	0	525	0	525 USD	104.43%	548'247.00	0.13	a)
XS2689095086	5.8750 % ENEDEV 5 7/8 09/21/33 REGS	0	500	0	500 USD	101.25%	506'250.00	0.12	a)
XS2692231975	9.0000 % EXCRTU 9 01/28/27 REGS	0	200	0	200 USD	104.31%	208'625.00	0.05	a)
XS2699906512	9.3750 % TCZIRA 9 3/8 11/12/26	0	200	0	200 USD	105.85%	211'706.00	0.05	a)
XS2701166717	7.8500 % UZBEK 7.85 10/12/28 REGS	0	400	0	400 USD	104.62%	418'460.00	0.10	a)
XS2706163131	6.0000 % PIFKSA 6 10/25/28	0	500	0	500 USD	103.19%	515'940.00	0.12	a)
XS2706163305	6.2500 % PIFKSA 6 1/4 10/25/33	0	250	0	250 USD	108.38%	270'937.50	0.06	a)
XS2707149600	5.8750 % MUBAUH 5 7/8 05/01/34 REGS	0	200	0	200 USD	106.75%	213'500.00	0.05	a)
XS2711511795	6.2500 % BGOSK 6 1/4 10/31/28 REGS	0	600	0	600 USD	103.84%	623'052.00	0.14	a)
XS2741927805	8.0000 % TCZIRA 8 01/16/29 REGS	0	200	0	200 USD	101.25%	202'500.00	0.05	a)
XS2744128369	5.5000 % REPHUN 5 1/2 03/26/36 REGS	0	1'750	200	1'550 USD	96.29%	1'492'526.00	0.35	a)
XS2747598444	4.7500 % KSA 4 3/4 01/16/30 REGS	0	550	0	550 USD	97.98%	538'884.50	0.13	a)
XS2747599095	5.0000 % KSA 5 01/16/34 REGS	0	700	0	700 USD	97.75%	684'250.00	0.16	a)
XS2747599509	5.7500 % KSA 5 3/4 01/16/54 REGS	0	1'000	0	1'000 USD	96.62%	966'150.00	0.22	a)
USD							417'884'118.70	97.19	

Nicht kotierte Wertpapiere

3'445'816.06 0.80

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

3'445'816.06 0.80

RU000A0JWHA4	4.7500 % RUSSIA 4 3/4 05/27/26 REGS	1'000	0	0	1'000 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
RU000A0JXTS9	4.2500 % RUSSIA 4 1/4 06/23/27 REGS	800	0	0	800 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
RU000A0JXU14	5.2500 % RUSSIA 5 1/4 06/23/47 REGS	2'000	0	0	2'000 USD	0.00%	0.02	0.00	c)
RU000A0ZYNN4	4.3750 % RUSSIA 4 3/8 03/21/29 REGS	800	0	0	800 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
RU000A1006S9	5.1000 % RUSSIA 5.1 03/28/35 REGS	1'200	0	0	1'200 USD	0.00%	0.01	0.00	c)
XS1303921487	0.0000 % UKRAIN 7 3/4 09/01/25 REGS	750	200	150	800 USD	30.55%	244'400.00	0.06	c)
XS1303925041	0.0000 % UKRAIN 7 3/4 09/01/26 REGS	850	0	0	850 USD	30.00%	254'957.50	0.06	c)
XS1303925470	0.0000 % UKRAIN 7 3/4 09/01/27 REGS	700	200	0	900 USD	28.96%	260'631.00	0.06	c)
XS1303926528	0.0000 % UKRAIN 7 3/4 09/01/28 REGS	600	550	300	850 USD	28.54%	242'615.50	0.06	c)
XS1303927179	0.0000 % UKRAIN 7 3/4 09/01/29 REGS	600	200	0	800 USD	28.25%	226'032.00	0.05	c)
XS1577952952	0.0000 % UKRAIN 7 3/8 09/25/34 REGS	1'400	800	200	2'000 USD	26.11%	522'220.00	0.12	c)
XS1843433472	8.2500 % RAILUA 8 1/4 07/09/26	200	200	0	400 USD	57.00%	228'016.00	0.05	c)
XS1902171591	0.0000 % UKRAIN 8.994 02/01/26 REGS	400	200	0	600 USD	31.98%	191'886.00	0.04	c)
XS1902171757	0.0000 % UKRAIN 9 3/4 11/01/30 REGS	800	250	0	1'050 USD	29.70%	311'808.00	0.07	c)
XS2010028699	0.0000 % UKRAIN 6.876 05/21/31 REGS	1'080	0	0	1'080 USD	25.06%	270'615.60	0.06	c)
XS2010030836	0.0000 % UKRAIN 7.253 03/15/35 REGS	1'490	0	0	1'490 USD	26.21%	390'469.40	0.09	c)
XS2077601610	7.6250 % NAFTA 7 5/8 11/08/28 REGS	200	0	0	200 USD	53.09%	106'187.50	0.02	c)
XS2357277149	0.0000 % UKRAVT 6 1/4 06/24/30 REGS	250	0	0	250 USD	26.39%	65'977.50	0.02	c)
XS2404309754	0.0000 % NPCUKR 6 7/8 11/09/28 REGS	400	0	0	400 USD	32.50%	130'000.00	0.03	c)

USD

3'445'816.06 0.80

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Devisentermingeschäfte

CHF/USD Verfall 11.10.2023	207'912	190'000	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 USD	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 13.11.2023		6'434'627	5'780'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.11.2023		112'927	100'000		USD/CHF	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF Verfall 04.04.2023	256'200'137	274'333'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.04.2023	1'559'751	1'666'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.04.2023	208'228	224'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.04.2023	36'693'090	40'334'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.04.2023	337'571	366'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 04.04.2023	1'546'957	1'689'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 04.04.2023	318'612'000	291'045'690	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	298'413'054	327'710'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	1'458'602	1'603'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	157'427	174'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	131'312	148'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	156'142	174'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	79'471	89'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.05.2023	58'618	66'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 03.05.2023	1'404'000	1'259'147	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 03.05.2023	328'560'000	292'411'829	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	293'532'621	330'961'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	2'778'949	3'133'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	1'728'473	1'939'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	331'645	375'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	148'681	167'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	534'088	602'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 02.06.2023	182'000	162'719	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	346'677	386'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	217'197	241'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	79'046	88'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	66'899	74'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	68'933	76'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 02.06.2023	321'744	356'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 02.06.2023	338'216'000	309'203'832	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 04.07.2023	321'530'000	287'634'307	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	297'228'581	326'382'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	295'241	326'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	190'801	211'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	350'496	388'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	97'753	108'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	205'212	229'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 05.07.2023	6'030'000	5'413'686	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	233'346	261'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 05.07.2023	392'000	351'831	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.07.2023	42'157	47'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	294'815'866	330'537'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	2'042'454	2'289'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	907'004	1'015'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	228'307	255'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 03.08.2023	1'170'000	1'046'694	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	305'828	345'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	106'356	124'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 03.08.2023	92'000	79'042	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	303'893	354'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	6'713'642	7'765'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	7'788	9'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	82'814	96'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 03.08.2023	251'602	290'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 03.08.2023	341'817'000	296'290'394	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD Verfall 04.09.2023	368'232'000	325'255'643	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	306'363'504	354'697'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	1'580'651	1'826'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	1'236'570	1'414'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	73'247	84'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	537'139	615'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	40'221	46'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	107'058	122'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	188'620	215'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	7'762'504	8'822'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF Verfall 05.09.2023	143'167	163'000	CHF/USD	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 USD	in % 7)	Kat.
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		200'952	228'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		313'197'650	355'672'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.10.2023		1'018'000	897'398	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		474'422	535'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.10.2023		256'000	227'785	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		99'632	112'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		22'277	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		22'391	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		101'863	114'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.10.2023		46'000	41'643	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		481'164	525'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.10.2023		355'688'000	325'401'167	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		304'037'021	333'405'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		826'500	902'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		453'713	494'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		470'264	513'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		156'803	172'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		49'703	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		1'378'520	1'531'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		43'430	48'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		830'961	920'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		171'750	192'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		10'923'000	9'850'427	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		327'309'000	297'883'921	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		288'784'506	318'390'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.12.2023		2'094'000	1'899'308	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		1'002'604	1'105'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		113'772	127'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		5'559'687	6'203'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.12.2023		191'000	168'400	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		94'681	107'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.12.2023		40'000	35'254	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.12.2023		161'000	141'761	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		2'584'885	2'944'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.12.2023		326'390'000	283'799'369	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		310'385'175	358'254'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'526'700	1'756'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		273'000	237'360	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		194'251	223'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		10'098'247	11'588'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		93'532	107'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		374'000	328'074	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		104'894	120'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		153'000	132'248	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		176'000	152'297	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		2'028'000	1'743'865	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		29'000	24'827	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		128'561	152'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		369'167'000	310'694'639	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		333'767'451	397'812'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		79'908	94'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'325'481	1'564'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		351'631	416'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2024		127'000	107'994	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		300'738	354'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2024		660'000	563'356	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		495'008	571'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2024		780'000	672'953	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		351'225	407'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		302'250	350'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'609'182	1'864'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2024		401'865'000	344'723'816	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		352'085'467	411'845'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		3'012'588	3'517'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'142'397	1'330'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		157'330	181'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		198'820	229'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.03.2024		43'000	37'529	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		208'816	236'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.03.2024		98'000	86'236	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		51'116	58'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		33'460	38'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		51'922	59'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.03.2024		98'000	86'133	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 USD	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		417'254'000	367'429'700		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		359'266'008	409'315'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'735'026.42	0.64
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	421'329'934.76	97.99
Sonstige Vermögenswerte	5'892'768.83	1.37
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	429'957'730.01	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-116'040.97	
Andere Verbindlichkeiten	-8'231.70	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	429'833'457.34	

Bewertungskategorien	Kurswert USD	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);	417'884'118.70	97.19
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.	3'445'816.06	0.80

Die unter der Bewertungskategorie c) aufgeführten Wertpapiere mit Domizil Russland wurden aufgrund des Ukraine-Krieges und den damit verbundenen Finanzsanktionen (u.a. Verbot von Transaktionen mit der russischen Zentralbank) mit einem entsprechenden Preisabschlag bewertet.

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CHF 1 = USD 1.13565385

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	408'001'825.59	94.921
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	-	-

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	
GTH1 CHF	USD	0.00 - 0.58	-	0.468	0.00 - 0.08	-	0.013
NT USD	USD	0.00 - 0.58	-	0.468	0.00 - 0.08	-	0.013
NTH1 CHF	USD	0.00 - 0.58	-	0.468	0.00 - 0.08	-	0.013
STH1 CHF	USD	0.00 - 0.58	-	0.468	0.00 - 0.08	-	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.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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
NT USD	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000
STH1 CHF	-	-	-	-	3.000

Periode: 01.03.2023 - 20.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
GTH1 CHF	0.260	0.400	0.210	0.050	3.000

Periode: 21.02.2024 - 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
GTH1 CHF	0.200	0.400	0.150	0.050	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

J.P.Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified 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 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
GTH1 CHF	Ja	USD	4.738	1.658	3.080
NT USD	Ja	USD	5.849	2.047	3.802
NTH1 CHF	Ja	USD	5.017	1.755	3.262
STH1 CHF	Ja	USD	5'016.67	1'755.83	3'260.84

11 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.

12 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 (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 Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

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

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

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

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

2.2 Umtauschverhältnisse

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

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

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

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

Zürich, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

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

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

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

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

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5. Die Fondsleitung darf für Repos sämtliche Arten von Effekten verwenden, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen wurden, dürfen nicht für Repos verwendet werden.
6. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerkzeuge nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die in Pension gegebenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom repofähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% für Repos verwenden. Sichert hingegen die Gegenpartei bzw. der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerkzeug wieder rechtlich über die in Pension gegebenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte repofähige Bestand einer Art für Repos verwendet werden.
7. Repos gelten als Kreditaufnahme gemäss § 13, es sei denn, die erhaltenen Mittel werden für die Übernahme von Effekten gleicher Art, Güte, Bonität und Laufzeit in Verbindung mit dem Abschluss eines Reverse Repo verwendet.
8. Die Fondsleitung darf im Rahmen eines Reverse Repo nur Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA erwerben. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei 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 Garant unter das geforderte Mindestrating sinken, so sind die noch offenen Positionen unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist glattzustellen (vgl. § 13 Ziff. 15, 17 und 18 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

betreffend

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

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

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

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

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

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

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

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

Zudem wird bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I), Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung).

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

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

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

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

2 Gating-Verfahren

2.1 Einführung Gating-Verfahren bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I), Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 23. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

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

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

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

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich