

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND CORP. CHF RESPONSIBLE

Jahresbericht per 29.02.2024

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

| Klasse | Valor | Währung |
|---------------|--------------|----------------|
| FA CHF | 111719600 | CHF |
| GA CHF | 116358348 | CHF |
| GT CHF | 111719601 | CHF |
| NT CHF | 111719603 | CHF |
| ST CHF | 111719602 | CHF |

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

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

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|----|---|----|
| 1 | Organisation und Verwaltung | 2 |
| 2 | Vertriebsorganisation | 3 |
| 3 | Abschlusszahlen | 4 |
| 4 | Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I | 22 |
| 5 | Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung | 22 |
| 6 | Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte | 22 |
| 7 | Pauschale Verwaltungskommission | 23 |
| 8 | Benchmark | 23 |
| 9 | TER | 23 |
| 10 | Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024 | 24 |
| 11 | Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024 | 24 |
| 12 | Fussnoten | 24 |
| 13 | Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte | 25 |
| 14 | Pflichtpublikationen | 27 |

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 | 27.02.2021 |
|---|------------|------------------|------------------|------------------|
| | bis | 29.02.2024 | 28.02.2023 | 28.02.2022 |
| Konsolidiert | | | | |
| | CHF | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 2'379'789'738.54 | 1'884'778'958.66 | 1'842'894'072.08 |
| Klasse FA CHF | | | | |
| | CHF | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 21'132'580.92 | 3'469'808.32 | 564'721.99 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 222'144.632 | 37'958.533 | 5'867.800 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 95.1298 | 91.4105 | 96.2408 |
| Ausschüttung je Anteil | | 0.95 | 0.85 | - |
| Total Expense Ratio (TER) | | 0.16 % | 0.16 % | 0.16 % |
| Klasse GA CHF | | | | |
| | CHF | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 2'488'848.73 | 18'632'525.09 | 9'922.37 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 25'281.311 | 197'625.190 | 100.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 98.4462 | 94.2821 | 99.2237 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR | | 103.3140 | 94.8555 | 96.2885 |
| Ausschüttung je Anteil | | 1.00 | 0.60 | - |
| Total Expense Ratio (TER) | | 0.12 % | 0.12 % | 0.12 % |
| Klasse GT CHF | | | | |
| | CHF | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 47'114'595.65 | 129'729'969.21 | 57'207'789.30 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 491'972.930 | 1'420'173.676 | 594'276.823 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 95.7666 | 91.3480 | 96.2645 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR | | 100.5020 | 91.9035 | 93.4168 |
| Thesaurierung je Anteil | | 0.96 | 0.60 | 0.34 |
| Total Expense Ratio (TER) | | 0.12 % | 0.12 % | 0.12 % |
| Klasse NT CHF | | | | |
| | CHF | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 2'309'053'713.24 | 1'732'946'656.04 | 1'785'111'638.42 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 24'052'446.723 | 18'939'354.292 | 18'529'941.359 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) | | 96.0008 | 91.4998 | 96.3366 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR | | 100.7477 | 92.0562 | 93.4868 |
| Thesaurierung je Anteil | | 1.07 | 0.71 | 0.41 |
| Total Expense Ratio (TER) | | 0.00 % | 0.00 % | 0.00 % |

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

Performance

| | 2023 / 2024 | 2023 | 2022 | 2021 |
|---|-------------|--------|---------|---------|
| Klasse FA CHF (Lancierung 16.07.2021) | 5.04 % | 5.72 % | -8.57 % | -0.80 % |
| Klasse GA CHF (Lancierung 23.02.2022) | 5.08 % | 5.76 % | -6.46 % | - |
| Klasse GT CHF (Lancierung 16.07.2021) | 5.08 % | 5.76 % | -8.53 % | -0.79 % |
| Klasse NT CHF (Lancierung 16.07.2021) | 5.21 % | 5.89 % | -8.42 % | -0.73 % |
| Klasse ST CHF (Lancierung 16.07.2021, Schliessung 08.10.2021) | - | - | - | -0.61 % |
| Benchmark | 4.98 % | 5.70 % | -8.99 % | -0.75 % |
| Tracking Error 33) | 0.11 % | 0.11 % | 0.56 % | 0.79 % |

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

Tracking Differenz

Klasse

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Klasse FA CHF (Lancierung 16.07.2021) | 0.06 % |
| Klasse GA CHF (Lancierung 23.02.2022) | 0.10 % |
| Klasse GT CHF (Lancierung 16.07.2021) | 0.10 % |
| Klasse NT CHF (Lancierung 16.07.2021) | 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 | 4'979'011.89 | 11'305'065.66 |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 2'356'802'928.11 | 1'864'671'167.00 |
| Sonstige Vermögenswerte | 18'017'057.57 | 8'816'814.75 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 2'379'798'997.57 | 1'884'793'047.41 |
| Andere Verbindlichkeiten | -9'259.03 | -14'088.75 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 2'379'789'738.54 | 1'884'778'958.66 |

Entwicklung der Anzahl Anteile

| | von bis | 01.03.2023 29.02.2024 | 01.03.2022 28.02.2023 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| Klasse FA CHF | | | |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 37'958.533 | 5'867.800 |
| Ausgegebene Anteile | | 224'786.177 | 33'235.516 |
| Zurückgenommene Anteile | | -40'600.078 | -1'144.783 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 222'144.632 | 37'958.533 |
| Klasse GA CHF | | | |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 197'625.190 | 100.000 |
| Ausgegebene Anteile | | 86'199.436 | 199'016.379 |
| Zurückgenommene Anteile | | -258'543.315 | -1'491.189 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 25'281.311 | 197'625.190 |
| Klasse GT CHF | | | |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 1'420'173.676 | 594'276.823 |
| Ausgegebene Anteile | | 489'635.871 | 958'456.034 |
| Zurückgenommene Anteile | | -1'417'836.617 | -132'559.181 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 491'972.930 | 1'420'173.676 |
| Klasse NT CHF | | | |
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 18'939'354.292 | 18'529'941.359 |
| Ausgegebene Anteile | | 5'946'328.455 | 1'395'808.404 |
| Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen) | | 3'786'315.801 | 1'587'959.692 |
| Zurückgenommene Anteile | | -493'961.175 | -721'617.392 |
| Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen) | | -4'125'590.650 | -1'852'737.771 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 24'052'446.723 | 18'939'354.292 |

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

| | Datum | Gegenwert | Anteile |
|---------------|------------|----------------|---------------|
| Klasse NT CHF | 08.03.2023 | 9'248'492.92 | 101'353.236 |
| Klasse NT CHF | 09.05.2023 | 1'719'597.13 | 18'578.028 |
| Klasse NT CHF | 09.05.2023 | 28'914'385.68 | 312'382.625 |
| Klasse NT CHF | 09.06.2023 | 24'200'573.54 | 261'895.380 |
| Klasse NT CHF | 09.06.2023 | 23'457'059.94 | 253'849.175 |
| Klasse NT CHF | 07.09.2023 | 15'114'256.92 | 162'324.800 |
| Klasse NT CHF | 08.09.2023 | 1'873'884.32 | 20'130.635 |
| Klasse NT CHF | 29.11.2023 | 39'368'560.21 | 414'604.034 |
| Klasse NT CHF | 08.12.2023 | 190'670'727.20 | 1'997'997.789 |
| Klasse NT CHF | 22.01.2024 | 6'165'022.90 | 64'606.019 |
| Klasse NT CHF | 19.02.2024 | 1'834'230.12 | 19'177.681 |
| Klasse NT CHF | 23.02.2024 | 15'289'276.11 | 159'416.399 |

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

| | Datum | Gegenwert | Anteile |
|---------------|------------|----------------|---------------|
| Klasse NT CHF | 12.06.2023 | 45'147'966.93 | 488'536.639 |
| Klasse NT CHF | 08.12.2023 | 347'087'337.62 | 3'637'054.011 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| | von bis | 01.03.2023 29.02.2024 | 01.03.2022 28.02.2023 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| Konsolidiert | | | |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode | | 1'884'778'958.66 | 1'842'894'072.08 |
| Ausbezahlte Ausschüttung | | -223'859.88 | 0.00 |
| Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | | -5'995'060.05 | -2'792'008.12 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | | 384'553'244.30 | 134'395'414.20 |
| Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung | | 116'676'455.51 | -89'718'519.50 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 2'379'789'738.54 | 1'884'778'958.66 |

Erfolgsrechnung

| Konsolidiert | von bis | 01.03.2023 29.02.2024 | 01.03.2022 28.02.2023 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| Ertrag | | | |
| Erträge der Bankguthaben auf Sicht | | 14'381.25 | 0.00 |
| Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht | | 0.00 | -75'350.65 |
| Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte | | 26'148'251.19 | 14'239'410.66 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | | 5'300'769.09 | 1'728'171.63 |
| Total Ertrag | | 31'463'401.53 | 15'892'231.64 |
| Aufwand | | | |
| Reglementarische Vergütungen | | -206'651.15 | -92'625.41 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | | -4'592'150.90 | -1'152'820.19 |
| Total Aufwand | | -4'798'802.05 | -1'245'445.60 |
| Nettoertrag / Verlust | | | |
| | | 26'664'599.48 | 14'646'786.04 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | -21'545'862.58 | -34'240'914.17 |
| Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen | | 2'566'900.85 | 955'851.93 |
| Realisierter Erfolg | | 7'685'637.75 | -18'638'276.20 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | 108'990'817.76 | -71'080'243.30 |
| Gesamterfolg | | 116'676'455.51 | -89'718'519.50 |

Verwendung des Erfolges

| | | | |
|--|----------------------|----------------------|--|
| Klasse FA CHF | | | |
| | 29.02.2024 | 28.02.2023 | |
| Nettoertrag | 212'578.17 | 31'923.80 | |
| Vortrag des Vorjahres | 1'529.12 | 1'870.07 | |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 214'107.29 | 33'793.87 | |
| Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg | 211'037.40 | 32'264.75 | |
| Vortrag auf neue Rechnung | 3'069.89 | 1'529.12 | |
| Total | 214'107.29 | 33'793.87 | |
| Klasse GA CHF | | | |
| | 29.02.2024 | 28.02.2023 | |
| Nettoertrag | 18'449.55 | 126'211.65 | |
| Vortrag des Vorjahres | 7'637.31 | 0.77 | |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 26'086.86 | 126'212.42 | |
| Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg | 25'281.31 | 118'575.11 | |
| Vortrag auf neue Rechnung | 805.55 | 7'637.31 | |
| Total | 26'086.86 | 126'212.42 | |
| Klasse GT CHF | | | |
| | 29.02.2024 | 28.02.2023 | |
| Nettoertrag | 474'831.32 | 863'622.94 | |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 474'831.32 | 863'622.94 | |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 166'190.96 | 302'268.03 | |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 308'640.36 | 561'354.91 | |
| Total | 474'831.32 | 863'622.94 | |
| Klasse NT CHF | | | |
| | 29.02.2024 | 28.02.2023 | |
| Nettoertrag | 25'958'740.44 | 13'625'027.65 | |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 25'958'740.44 | 13'625'027.65 | |
| Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer | 9'085'559.15 | 4'768'759.68 | |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 16'873'181.29 | 8'856'267.97 | |
| Total | 25'958'740.44 | 13'625'027.65 | |

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

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-------------------------|--------------|------|
| Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind | | | | | | | 2'356'802'928.11 | 99.03 | |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | | | | | | | 2'356'802'928.11 | 99.03 | |
| CH0026620846 | 3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26 | 7'840 | 1'160 | 0 | 9'000 CHF | 103.80% | 9'342'000.00 | 0.39 | a) |
| CH0109674488 | 3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25 | 4'500 | 2'795 | 1'500 | 5'795 CHF | 101.29% | 5'869'755.50 | 0.25 | a) |
| CH0117843745 | 2.5000 % BKWSW 2 1/2 10/15/30 | 0 | 5'370 | 0 | 5'370 CHF | 105.30% | 5'654'610.00 | 0.24 | a) |
| CH0119533278 | 3.1250 % UBS 3 1/8 11/12/30 EMTN | 1'615 | 250 | 0 | 1'865 CHF | 107.35% | 2'002'077.50 | 0.08 | a) |
| CH0122512152 | 2.6250 % RAIFFS 2 5/8 02/04/26 | 3'260 | 0 | 0 | 3'260 CHF | 101.70% | 3'315'420.00 | 0.14 | a) |
| CH0132163434 | 2.8750 % KWLILI 2 7/8 06/30/31 | 2'490 | 0 | 0 | 2'490 CHF | 107.00% | 2'664'300.00 | 0.11 | a) |
| CH0143302005 | 1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26 | 150 | 500 | 650 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0143838396 | 1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN | 1'300 | 500 | 1'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0180428531 | 2.8750 % KWLILI 2 7/8 03/27/42 | 2'180 | 0 | 0 | 2'180 CHF | 109.90% | 2'395'820.00 | 0.10 | a) |
| CH0185843015 | 1.1250 % EBN 1 1/8 07/04/24 | 2'180 | 0 | 2'180 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0188335365 | 1.7500 % SCMNIX 1 3/4 07/10/24 | 5'275 | 100 | 5'275 | 100 CHF | 99.99% | 99'990.00 | 0.00 | a) |
| CH0194958960 | 3.0000 % KWLILI 3 09/27/52 | 3'100 | 0 | 0 | 3'100 CHF | 111.80% | 3'465'800.00 | 0.15 | a) |
| CH0195288193 | 1.6250 % ENGIFP 1 5/8 10/09/24 EMTN | 900 | 0 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0198415074 | 4.0000 % ENELIM 4 10/26/27 EMTN | 150 | 0 | 0 | 150 CHF | 108.10% | 162'150.00 | 0.01 | a) |
| CH0200044789 | 2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28 | 3'300 | 1'050 | 4'350 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0200044805 | 1.8750 % KWOPER 1 7/8 02/21/25 | 2'800 | 1'300 | 1'500 | 2'600 CHF | 100.18% | 2'604'680.00 | 0.11 | a) |
| CH0204811100 | 1.6250 % SWISSG 1 5/8 01/30/25 | 3'940 | 0 | 3'940 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0208271541 | 3.0000 % KWLILI 3 04/02/48 | 1'750 | 0 | 0 | 1'750 CHF | 111.75% | 1'955'625.00 | 0.08 | a) |
| CH0225071593 | 1.8750 % HILTI 1 7/8 10/30/23 | 920 | 0 | 920 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0226752290 | 2.0000 % ULFP 2 11/20/23 EMTN | 1'400 | 0 | 1'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0227694574 | 1.8750 % SPITLI 1 7/8 11/29/23 | 2'100 | 0 | 2'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0228531437 | 2.3750 % KWLILI 2 3/8 12/10/26 | 1'700 | 1'500 | 0 | 3'200 CHF | 101.75% | 3'256'000.00 | 0.14 | a) |
| CH0235834154 | 1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN | 4'950 | 645 | 5'595 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0236122740 | 1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24 | 4'535 | 500 | 5'035 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0237552101 | 1.7500 % GIVNVX 1 3/4 03/19/24 | 4'050 | 0 | 4'050 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0238053125 | 1.7500 % BPLN 1 3/4 02/28/24 | 3'070 | 0 | 3'070 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0239312207 | 1.5000 % BCVAUD 1 1/2 03/28/24 | 1'800 | 0 | 1'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0240109618 | 1.8750 % GZOWTZ 1 7/8 06/12/24 | 3'200 | 0 | 3'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0240109774 | 1.6250 % ENGAKR 1 5/8 04/25/24 | 2'800 | 0 | 2'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0240672227 | 1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24 | 3'000 | 2'000 | 5'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0240672235 | 2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29 | 3'400 | 210 | 0 | 3'610 CHF | 100.25% | 3'619'025.00 | 0.15 | a) |
| CH0243069280 | 2.0000 % BFCM 2 05/22/24 EMTN | 800 | 0 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0244692536 | 2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24 | 2'700 | 700 | 3'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0244717978 | 1.5000 % ELOFR 1 1/2 06/03/24 EMTN | 2'100 | 0 | 2'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0245691537 | 1.7500 % NANTDR 1 3/4 07/18/24 | 3'800 | 0 | 3'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0247611269 | 1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26 | 5'605 | 300 | 0 | 5'905 CHF | 100.25% | 5'919'762.50 | 0.25 | a) |
| CH0247776138 | 1.5000 % SCMNIX 1 1/2 07/14/26 | 4'750 | 500 | 0 | 5'250 CHF | 100.20% | 5'260'500.00 | 0.22 | a) |
| CH0247902890 | 1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN | 10'125 | 50 | 10'175 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0247902916 | 1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN | 3'650 | 700 | 4'350 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0248890490 | 2.6250 % ALPHSW 2 5/8 07/29/24 | 4'590 | 0 | 4'590 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0249483683 | 1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155 | 4'725 | 100 | 4'825 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0252379802 | 1.8750 % MOBNSW 1 7/8 09/16/24 | 4'000 | 0 | 4'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0252703050 | 1.2500 % KWLILI 1 1/4 09/11/24 | 3'380 | 0 | 3'380 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0253225954 | 0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26 | 1'315 | 750 | 0 | 2'065 CHF | 98.60% | 2'036'090.00 | 0.09 | a) |
| CH0253613548 | 1.3750 % BUCNSW 1 3/8 10/02/24 | 575 | 0 | 575 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0254147504 | 1.5000 % SCMNIX 1 1/2 09/28/29 | 5'200 | 0 | 0 | 5'200 CHF | 100.75% | 5'239'000.00 | 0.22 | a) |
| CH0255475292 | 1.0000 % LISNSW 1 10/08/24 | 3'340 | 1'100 | 4'440 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0255893122 | 1.5000 % HELNSW 1 1/2 04/28/25 | 2'825 | 500 | 0 | 3'325 CHF | 99.81% | 3'318'682.50 | 0.14 | a) |
| CH0257042173 | 2.0000 % SPSNSW 2 12/10/24 | 2'300 | 800 | 3'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0260769424 | 1.3750 % T 1 3/8 12/04/24 | 11'150 | 0 | 11'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0260769440 | 1.8750 % T 1 7/8 12/04/30 | 1'600 | 0 | 0 | 1'600 CHF | 102.00% | 1'632'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0261399064 | 1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24 | 2'750 | 0 | 2'750 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0262881441 | 0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27 | 6'000 | 100 | 0 | 6'100 CHF | 98.55% | 6'011'550.00 | 0.25 | a) |
| CH0262881458 | 1.0000 % PSPNSW 1 02/06/25 | 3'250 | 0 | 0 | 3'250 CHF | 99.30% | 3'227'250.00 | 0.14 | a) |
| CH0262883199 | 1.3750 % GRANDX 1 3/8 02/18/25 | 1'000 | 1'250 | 2'250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0262888941 | 0.8750 % VBPSW 0 7/8 10/07/24 | 1'500 | 0 | 1'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0266842704 | 1.0000 % ACAFP 1 01/27/25 EMTN | 0 | 2'750 | 2'750 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0268988182 | 1.0000 % SCMN VX 1 04/17/35 | 4'150 | 110 | 0 | 4'260 CHF | 94.25% | 4'015'050.00 | 0.17 | a) |
| CH0269382088 | 0.6250 % SWISSG 0 5/8 02/25/30 | 2'900 | 150 | 0 | 3'050 CHF | 95.10% | 2'900'550.00 | 0.12 | a) |
| CH0270190983 | 0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25 | 8'110 | 3'100 | 0 | 11'210 CHF | 98.61% | 11'054'181.00 | 0.46 | a) |
| CH0270190991 | 0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29 | 6'110 | 3'300 | 0 | 9'410 CHF | 96.15% | 9'047'715.00 | 0.38 | a) |
| CH0270191007 | 1.0500 % NOVNVX 1.05 05/11/35 | 8'300 | 0 | 0 | 8'300 CHF | 95.65% | 7'938'950.00 | 0.33 | a) |
| CH0271171685 | 0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24 | 12'095 | 4'200 | 16'295 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0271171693 | 0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30 | 6'170 | 1'000 | 0 | 7'170 CHF | 96.95% | 6'951'315.00 | 0.29 | a) |
| CH0272024669 | 0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN | 7'560 | 0 | 7'560 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0273347838 | 1.3750 % ALLNSW 1 3/8 03/31/25 | 2'400 | 0 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0273925989 | 0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN | 3'450 | 0 | 3'450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0274758835 | 1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25 | 1'550 | 1'550 | 1'550 | 1'550 CHF | 99.05% | 1'535'275.00 | 0.06 | a) |
| CH0276581094 | 0.5500 % SPITLI 0.55 05/15/25 | 1'300 | 3'300 | 2'300 | 2'300 CHF | 98.40% | 2'263'200.00 | 0.10 | a) |
| CH0279135328 | 0.8750 % SGSNVX 0 7/8 05/08/30 | 3'440 | 650 | 0 | 4'090 CHF | 96.50% | 3'946'850.00 | 0.17 | a) |
| CH0282018982 | 0.5000 % TTEFP 0 1/2 06/01/27 EMTN | 3'400 | 250 | 0 | 3'650 CHF | 97.40% | 3'555'100.00 | 0.15 | a) |
| CH0282019006 | 1.2500 % SRVIND 1 1/4 06/30/25 | 3'150 | 500 | 0 | 3'650 CHF | 99.50% | 3'631'750.00 | 0.15 | a) |
| CH0282344339 | 1.7500 % BNP 1 3/4 06/05/25 EMTN | 1'700 | 0 | 0 | 1'700 CHF | 99.77% | 1'696'090.00 | 0.07 | a) |
| CH0284415681 | 0.5500 % NDAFH 0.55 06/23/25 EMTN | 6'720 | 0 | 0 | 6'720 CHF | 98.70% | 6'632'640.00 | 0.28 | a) |
| CH0287817859 | 0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24 | 3'225 | 0 | 3'225 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0292877898 | 0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN | 8'850 | 1'250 | 0 | 10'100 CHF | 97.65% | 9'862'650.00 | 0.41 | a) |
| CH0292984454 | 2.1250 % ACAFP 2 1/8 09/29/25 EMTN | 0 | 2'350 | 0 | 2'350 CHF | 100.55% | 2'362'925.00 | 0.10 | a) |
| CH0297782952 | 1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/21/23 | 900 | 0 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0297974898 | 1.0000 % KO 1 10/02/28 | 9'100 | 1'200 | 0 | 10'300 CHF | 98.70% | 10'166'100.00 | 0.43 | a) |
| CH0299477353 | 0.5000 % WFC 0 1/2 11/02/23 EMTN | 3'525 | 0 | 3'525 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0299477361 | 0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25 | 6'365 | 900 | 7'265 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0302790115 | 0.2500 % NDAFH 0 1/4 11/27/23 EMTN | 2'200 | 0 | 2'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0303138520 | 0.1000 % DBHNGR 0.1 12/01/25 EMTN | 2'690 | 250 | 0 | 2'940 CHF | 97.80% | 2'875'320.00 | 0.12 | a) |
| CH0303925652 | 0.5500 % BFCM 0.55 12/08/23 EMTN | 1'760 | 0 | 1'760 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0305558030 | 1.1250 % DHR 1 1/8 12/08/28 | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 98.60% | 2'760'800.00 | 0.12 | a) |
| CH0306179125 | 1.0000 % HOLNSW 1 12/04/25 | 890 | 0 | 0 | 890 CHF | 99.30% | 883'770.00 | 0.04 | a) |
| CH0306626224 | 2.0000 % NANTDR 2 02/02/26 | 4'090 | 1'205 | 5'295 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0306770600 | 0.3750 % WSTPNZ 0 3/8 02/05/24 EMTN | 5'725 | 0 | 5'725 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0307256435 | 0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24 | 4'700 | 0 | 4'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0310175515 | 0.7500 % MQGAU 0 3/4 02/05/24 EMTN | 3'360 | 0 | 3'360 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0310451858 | 1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26 | 3'000 | 1'400 | 0 | 4'400 CHF | 99.00% | 4'356'000.00 | 0.18 | a) |
| CH0311427584 | 0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN | 6'375 | 0 | 6'375 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0312512681 | 0.6250 % BELLSW 0 5/8 03/24/25 | 0 | 5'050 | 0 | 5'050 CHF | 98.77% | 4'987'885.00 | 0.21 | a) |
| CH0312512723 | 0.6250 % ALLNSW 0 5/8 05/10/24 | 2'650 | 0 | 2'650 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0315593860 | 0.3000 % ABNAV 0.3 12/18/24 EMTN | 1'620 | 0 | 1'620 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0317921663 | 0.3750 % SCMN VX 0 3/8 03/31/28 | 1'000 | 1'000 | 0 | 2'000 CHF | 95.95% | 1'919'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0319403777 | 0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26 | 6'750 | 250 | 0 | 7'000 CHF | 97.20% | 6'804'000.00 | 0.29 | a) |
| CH0319415953 | 0.5500 % UBS 0.55 04/15/24 EMTN | 2'800 | 0 | 2'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0319415961 | 0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26 | 4'600 | 30 | 0 | 4'630 CHF | 98.65% | 4'567'495.00 | 0.19 | a) |
| CH0319415987 | 0.5000 % COOPSW 0 1/2 05/19/26 | 5'700 | 0 | 5'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0319415995 | 0.4500 % JPM 0.45 11/11/26 EMTN | 2'200 | 1'000 | 0 | 3'200 CHF | 97.15% | 3'108'800.00 | 0.13 | a) |
| CH0319932767 | 0.4000 % BCVAUD 0.4 04/07/31 | 1'100 | 0 | 1'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0320712596 | 0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25 | 7'520 | 600 | 0 | 8'120 CHF | 98.47% | 7'995'764.00 | 0.34 | a) |
| CH0320712604 | 0.7500 % RAIFFS 0 3/4 04/22/31 | 2'450 | 0 | 0 | 2'450 CHF | 92.80% | 2'273'600.00 | 0.10 | a) |
| CH0323735602 | 0.4500 % LLY 0.45 05/24/28 EMTN | 0 | 5'350 | 0 | 5'350 CHF | 96.55% | 5'165'425.00 | 0.22 | a) |
| CH0323735677 | 0.5500 % ACAFP 0.55 12/14/26 EMTN | 0 | 1'950 | 0 | 1'950 CHF | 97.15% | 1'894'425.00 | 0.08 | a) |
| CH0325429188 | 0.3750 % VOD 0 3/8 12/03/24 EMTN | 4'100 | 500 | 4'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0326213912 | 0.2500 % KISPZ 0 1/4 07/28/28 | 1'900 | 1'110 | 0 | 3'010 CHF | 94.50% | 2'844'450.00 | 0.12 | a) |
| CH0326213953 | 0.7500 % KISPZ 0 3/4 07/28/36 | 1'350 | 350 | 0 | 1'700 CHF | 87.65% | 1'490'050.00 | 0.06 | a) |
| CH0326371462 | 0.8750 % SUNSW 0 7/8 07/10/26 | 0 | 3'000 | 0 | 3'000 CHF | 98.00% | 2'940'000.00 | 0.12 | a) |
| CH0330049831 | 1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN | 3'400 | 0 | 3'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0330143147 | 1.7500 % AXPOSW 1 3/4 05/29/24 | 5'480 | 0 | 5'480 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0336352775 | 0.1250 % SCMN VX 0 1/8 09/15/32 | 2'650 | 500 | 0 | 3'150 CHF | 89.20% | 2'809'800.00 | 0.12 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0337645532 | 0.5000 % SPSNSW 0 1/2 11/03/25 | 2'960 | 0 | 0 | 2'960 CHF | 98.00% | 2'900'800.00 | 0.12 | a) |
| CH0337829268 | 0.5000 % VOD 0 1/2 09/19/31 EMTN | 2'400 | 750 | 0 | 3'150 CHF | 91.60% | 2'885'400.00 | 0.12 | a) |
| CH0338330431 | 0.2000 % LGT 0.2 10/12/26 | 5'020 | 0 | 5'020 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0338330456 | 0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN | 6'900 | 1'150 | 8'050 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0340912168 | 0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN | 3'800 | 500 | 0 | 4'300 CHF | 97.30% | 4'183'900.00 | 0.18 | a) |
| CH0340953428 | 0.5000 % BCVAUD 0 1/2 12/13/28 | 1'400 | 0 | 1'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0341725858 | 0.3000 % EDF 0.3 10/14/24 EMTN | 6'030 | 1'000 | 7'030 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0341725866 | 0.6500 % EDF 0.65 10/13/28 EMTN | 3'200 | 3'700 | 3'450 | 3'450 CHF | 95.85% | 3'306'825.00 | 0.14 | a) |
| CH0343366784 | 0.6250 % GIVNVX 0 5/8 12/05/31 | 2'700 | 0 | 0 | 2'700 CHF | 93.90% | 2'535'300.00 | 0.11 | a) |
| CH0344583783 | 0.3750 % SCMNVX 0 3/8 12/15/27 | 1'450 | 0 | 0 | 1'450 CHF | 96.35% | 1'397'075.00 | 0.06 | a) |
| CH0346828434 | 0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN | 3'000 | 1'000 | 0 | 4'000 CHF | 97.90% | 3'916'000.00 | 0.16 | a) |
| CH0350030414 | 0.2000 % ASBANK 0.2 08/02/24 EMTN | 4'360 | 0 | 4'360 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0350030422 | 0.7000 % KWOPER 0.7 01/30/26 | 900 | 0 | 0 | 900 CHF | 98.10% | 882'900.00 | 0.04 | a) |
| CH0352595927 | 0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26 | 6'600 | 1'250 | 0 | 7'850 CHF | 97.95% | 7'689'075.00 | 0.32 | a) |
| CH0353428060 | 0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN | 3'550 | 10 | 3'560 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0354836113 | 0.7500 % MOBNSW 0 3/4 03/20/26 | 3'295 | 400 | 0 | 3'695 CHF | 97.80% | 3'613'710.00 | 0.15 | a) |
| CH0355139855 | 0.3200 % BFCM 0.32 02/10/25 EMTN | 2'550 | 250 | 2'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0357483160 | 2.0000 % KWLILI 2 12/11/23 | 3'300 | 0 | 3'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0357520433 | 0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN | 3'400 | 0 | 0 | 3'400 CHF | 98.05% | 3'333'700.00 | 0.14 | a) |
| CH0357520466 | 0.6250 % VOD 0 5/8 03/15/27 EMTN | 5'000 | 1'200 | 0 | 6'200 CHF | 97.40% | 6'038'800.00 | 0.25 | a) |
| CH0357676110 | 0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27 | 1'950 | 300 | 2'250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0358654975 | 0.1000 % ROSW 0.1 09/23/24 2024 | 10'730 | 1'000 | 11'730 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0359915409 | 0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029 | 6'050 | 450 | 6'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0360172693 | 0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24 | 3'000 | 0 | 3'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0360172701 | 0.5750 % BANCO 0.575 04/07/27 EMTN | 1'900 | 700 | 0 | 2'600 CHF | 95.00% | 2'470'000.00 | 0.10 | a) |
| CH0360677287 | 0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27 | 3'650 | 3'000 | 6'650 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0360677295 | 0.8250 % SPSNSW 0.825 05/11/26 | 5'050 | 3'150 | 0 | 8'200 CHF | 98.15% | 8'048'300.00 | 0.34 | a) |
| CH0361532895 | 0.1500 % PGHNSW 0.15 06/07/24 | 3'000 | 0 | 3'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0361532903 | 0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0 | 3'100 | 500 | 0 | 3'600 CHF | 92.80% | 3'340'800.00 | 0.14 | a) |
| CH0361532952 | 1.1250 % GRANDX 1 1/8 07/04/24 | 3'000 | 0 | 3'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0362748359 | 0.3750 % SCMNVX 0 3/8 05/31/27 | 8'250 | 600 | 0 | 8'850 CHF | 96.95% | 8'580'075.00 | 0.36 | a) |
| CH0363645505 | 0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/27/23 EMTN | 2'250 | 0 | 2'250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0365501474 | 0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN | 5'740 | 75 | 5'815 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0365501508 | 0.2500 % HIGHWY 0 1/4 06/07/24 GMTN | 2'720 | 0 | 2'720 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0367206700 | 1.0000 % GALESW 1 12/15/26 | 3'090 | 4'005 | 3'090 | 4'005 CHF | 98.45% | 3'942'922.50 | 0.17 | a) |
| CH0367206718 | 0.3750 % CMBNSW 0 3/8 06/27/25 | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 98.25% | 884'250.00 | 0.04 | a) |
| CH0367206742 | 0.7000 % LONNVX 0.7 07/12/24 | 2'700 | 0 | 2'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0368697758 | 0.5000 % EMMI 0 1/2 06/21/29 | 1'740 | 2'740 | 1'740 | 2'740 CHF | 94.80% | 2'597'520.00 | 0.11 | a) |
| CH0368825474 | 0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN | 4'000 | 700 | 0 | 4'700 CHF | 97.80% | 4'596'600.00 | 0.19 | a) |
| CH0372831534 | 1.1250 % SANTAN 1 1/8 07/20/27 | 1'940 | 0 | 0 | 1'940 CHF | 98.40% | 1'908'960.00 | 0.08 | a) |
| CH0372831567 | 0.5000 % BCVAUD 0 1/2 07/12/29 | 1'730 | 2'000 | 3'730 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476040 | 0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25 | 0 | 4'225 | 0 | 4'225 CHF | 98.05% | 4'142'612.50 | 0.17 | a) |
| CH0373476164 | 0.7500 % SCMNVX 0 3/4 11/24/33 | 4'800 | 600 | 0 | 5'400 CHF | 92.90% | 5'016'600.00 | 0.21 | a) |
| CH0373476214 | 0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24 | 3'400 | 975 | 4'375 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476222 | 0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0 | 2'700 | 100 | 2'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476636 | 1.0500 % GEOFIS 1.05 04/20/28 0 | 2'200 | 0 | 0 | 2'200 CHF | 97.60% | 2'147'200.00 | 0.09 | a) |
| CH0373476800 | 0.7500 % COOPSW 0 3/4 06/06/25 | 4'700 | 1'250 | 5'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0373476974 | 1.2500 % SEESPI 1 1/4 07/03/26 | 2'075 | 2'075 | 2'075 | 2'075 CHF | 98.15% | 2'036'612.50 | 0.09 | a) |
| CH0379268672 | 0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN | 5'050 | 405 | 5'455 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0379268698 | 0.3000 % LISNSW 0.3 10/06/27 | 6'850 | 0 | 0 | 6'850 CHF | 96.10% | 6'582'850.00 | 0.28 | a) |
| CH0379268706 | 0.4000 % GVAERO 0.4 09/20/27 | 2'800 | 1'000 | 0 | 3'800 CHF | 95.40% | 3'625'200.00 | 0.15 | a) |
| CH0379268714 | 0.5000 % COOPSW 0 1/2 09/29/27 | 3'200 | 150 | 3'350 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0379610972 | 0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN | 2'750 | 500 | 0 | 3'250 CHF | 96.65% | 3'141'125.00 | 0.13 | a) |
| CH0382451646 | 0.5000 % ACHMEA 0 1/2 10/03/25 EMTN | 3'250 | 0 | 0 | 3'250 CHF | 98.15% | 3'189'875.00 | 0.13 | a) |
| CH0383104335 | 0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN | 12'600 | 1'320 | 3'000 | 10'920 CHF | 96.30% | 10'515'960.00 | 0.44 | a) |
| CH0383104343 | 0.5500 % NESNVX 0.55 10/04/32 EMTN | 2'800 | 0 | 0 | 2'800 CHF | 93.10% | 2'606'800.00 | 0.11 | a) |
| CH0384125040 | 0.3000 % MUNHYP 0.3 12/20/24 1775 | 2'100 | 0 | 2'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0384125115 | 0.2000 % HILTI 0.2 11/08/24 | 2'200 | 0 | 2'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0384125123 | 0.4000 % HILTI 0.4 11/08/27 | 2'600 | 0 | 0 | 2'600 CHF | 96.00% | 2'496'000.00 | 0.10 | a) |
| CH0384629892 | 1.0000 % DOKASW 1 10/13/25 | 4'100 | 2'350 | 0 | 6'450 CHF | 98.55% | 6'356'475.00 | 0.27 | a) |
| CH0385518045 | 0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN | 6'450 | 1'700 | 0 | 8'150 CHF | 97.20% | 7'921'800.00 | 0.33 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0385997041 | 0.8750 % AMALEA 0 7/8 10/25/24 | 2'400 | 0 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0385997108 | 0.4500 % DBHNGR 0.45 11/08/30 EMTN | 4'450 | 2'750 | 0 | 7'200 CHF | 94.25% | 6'786'000.00 | 0.29 | a) |
| CH0387879056 | 0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN | 2'450 | 900 | 0 | 3'350 CHF | 97.85% | 3'277'975.00 | 0.14 | a) |
| CH0389606085 | 0.6000 % BUHLER 0.6 12/21/26 | 5'550 | 1'000 | 0 | 6'550 CHF | 96.95% | 6'350'225.00 | 0.27 | a) |
| CH0391491518 | 0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25 | 2'600 | 500 | 3'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0391648018 | 1.5500 % NANTDR 1.55 08/19/25 | 2'950 | 200 | 3'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0392885791 | 1.5000 % KKWLEB 1 1/2 08/07/24 | 2'250 | 50 | 2'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633229 | 0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24 | 3'320 | 0 | 3'320 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633252 | 1.0000 % SPSNSW 1 07/16/24 0 | 1'800 | 0 | 1'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398633344 | 0.6250 % LUZKAN 0 5/8 09/25/28 | 2'900 | 2'900 | 2'900 | 2'900 CHF | 95.85% | 2'779'650.00 | 0.12 | a) |
| CH0398633377 | 0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26 | 2'410 | 0 | 0 | 2'410 CHF | 96.85% | 2'334'085.00 | 0.10 | a) |
| CH0398633443 | 0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28 | 2'550 | 2'550 | 2'550 | 2'550 CHF | 95.65% | 2'439'075.00 | 0.10 | a) |
| CH0398633526 | 0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25 | 2'680 | 1'200 | 0 | 3'880 CHF | 98.60% | 3'825'680.00 | 0.16 | a) |
| CH0398633534 | 1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0 | 1'800 | 1'950 | 0 | 3'750 CHF | 98.55% | 3'695'625.00 | 0.16 | a) |
| CH0398633542 | 1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0 | 2'500 | 300 | 0 | 2'800 CHF | 98.20% | 2'749'600.00 | 0.12 | a) |
| CH0398633807 | 0.7000 % PSPNSW 0.7 02/08/27 0 | 1'100 | 0 | 0 | 1'100 CHF | 97.40% | 1'071'400.00 | 0.05 | a) |
| CH0398677689 | 0.7320 % ARNDTN 0.732 01/30/25 EMTN | 3'650 | 600 | 4'250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398677747 | 0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN | 3'700 | 300 | 4'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0398678919 | 0.7500 % BELLSW 0 3/4 02/01/28 | 0 | 1'800 | 0 | 1'800 CHF | 96.20% | 1'731'600.00 | 0.07 | a) |
| CH0398678927 | 0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN | 3'900 | 1'450 | 0 | 5'350 CHF | 95.85% | 5'127'975.00 | 0.22 | a) |
| CH0400971617 | 0.3500 % RAIFFS 0.35 02/16/24 | 4'025 | 0 | 4'025 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0401956864 | 0.4500 % VORHYP 0.45 03/05/24 EMTN | 2'700 | 0 | 2'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0401956872 | 0.9560 % GYCGR 0.956 09/01/26 EMTN | 1'700 | 0 | 0 | 1'700 CHF | 95.05% | 1'615'850.00 | 0.07 | a) |
| CH0404311687 | 0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN | 2'000 | 200 | 0 | 2'200 CHF | 98.88% | 2'175'360.00 | 0.09 | a) |
| CH0404599224 | 0.2500 % NAB 0 1/4 03/13/24 GMTN | 1'800 | 0 | 1'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0406990835 | 0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26 | 0 | 3'150 | 0 | 3'150 CHF | 98.40% | 3'099'600.00 | 0.13 | a) |
| CH0407809760 | 0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25 | 2'300 | 0 | 0 | 2'300 CHF | 98.75% | 2'271'250.00 | 0.10 | a) |
| CH0407809778 | 0.3660 % BFCM 0.366 10/10/24 EMTN | 2'100 | 1'000 | 3'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0409606362 | 1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN | 3'050 | 750 | 0 | 3'800 CHF | 98.75% | 3'752'500.00 | 0.16 | a) |
| CH0409938120 | 0.3500 % MUNHYP 0.35 12/12/23 EMTN | 800 | 0 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0409938153 | 0.6250 % DAESW 0 5/8 05/30/24 | 2'035 | 0 | 2'035 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0412528611 | 0.6330 % GSCCOR 0.633 01/31/24 | 800 | 0 | 800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0413618353 | 0.7000 % KSBAAR 0.7 05/23/28 | 3'400 | 0 | 0 | 3'400 CHF | 96.85% | 3'292'900.00 | 0.14 | a) |
| CH0413618361 | 1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33 | 1'600 | 2'250 | 0 | 3'850 CHF | 94.55% | 3'640'175.00 | 0.15 | a) |
| CH0417086045 | 1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN | 5'900 | 1'750 | 0 | 7'650 CHF | 99.20% | 7'588'800.00 | 0.32 | a) |
| CH0417086060 | 0.4000 % WSTP 0.4 06/06/24 EMTN | 3'000 | 0 | 3'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0418620180 | 1.0000 % BNP 1 06/06/25 EMTN | 3'125 | 0 | 0 | 3'125 CHF | 98.96% | 3'092'500.00 | 0.13 | a) |
| CH0419040750 | 0.4000 % BFCM 0.4 02/12/24 EMTN | 1'400 | 0 | 1'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419040768 | 2.0000 % KKWLEB 2 02/14/25 | 1'600 | 250 | 0 | 1'850 CHF | 100.05% | 1'850'925.00 | 0.08 | a) |
| CH0419040792 | 0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27 | 2'900 | 1'495 | 0 | 4'395 CHF | 97.65% | 4'291'717.50 | 0.18 | a) |
| CH0419040826 | 0.6000 % CM 0.6 01/30/25 EMTN | 2'300 | 0 | 2'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419040982 | 0.5000 % SCMNVSX 0 1/2 03/15/29 | 1'400 | 1'000 | 0 | 2'400 CHF | 95.75% | 2'298'000.00 | 0.10 | a) |
| CH0419040990 | 1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27 | 4'800 | 570 | 0 | 5'370 CHF | 98.70% | 5'300'190.00 | 0.22 | a) |
| CH0419041055 | 0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y | 1'700 | 50 | 1'750 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041063 | 0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28 | 1'920 | 50 | 0 | 1'970 CHF | 96.10% | 1'893'170.00 | 0.08 | a) |
| CH0419041139 | 0.3750 % BCSW 0 3/8 04/26/27 | 0 | 2'850 | 0 | 2'850 CHF | 96.10% | 2'738'850.00 | 0.12 | a) |
| CH0419041204 | 0.1250 % LLBSW 0 1/8 05/28/26 | 2'850 | 0 | 0 | 2'850 CHF | 96.70% | 2'755'950.00 | 0.12 | a) |
| CH0419041220 | 0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28 | 1'700 | 1'000 | 0 | 2'700 CHF | 95.65% | 2'582'550.00 | 0.11 | a) |
| CH0419041287 | 0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27 | 5'975 | 2'400 | 0 | 8'375 CHF | 96.15% | 8'052'562.50 | 0.34 | a) |
| CH0419041311 | 0.5000 % RENAUL 0 1/2 07/18/24 EMTN | 600 | 0 | 600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041352 | 0.2850 % CMBNSW 0.285 08/19/27 | 0 | 2'700 | 0 | 2'700 CHF | 95.40% | 2'575'800.00 | 0.11 | a) |
| CH0419041378 | 0.6250 % AAREKW 0 5/8 08/03/29 | 2'000 | 750 | 0 | 2'750 CHF | 95.00% | 2'612'500.00 | 0.11 | a) |
| CH0419041428 | 0.0000 % KSWINT 0 09/30/31 | 1'300 | 0 | 0 | 1'300 CHF | 88.45% | 1'149'850.00 | 0.05 | a) |
| CH0419041493 | 0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29 | 2'150 | 250 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041501 | 0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/50 | 1'200 | 0 | 0 | 1'200 CHF | 63.15% | 757'800.00 | 0.03 | a) |
| CH0419041527 | 0.0000 % LLBSW 0 09/27/29 | 800 | 0 | 0 | 800 CHF | 90.35% | 722'800.00 | 0.03 | a) |
| CH0419041535 | 0.0100 % BANCO 0.01 10/04/27 EMTN | 2'000 | 0 | 0 | 2'000 CHF | 92.25% | 1'845'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0419041543 | 0.2500 % ISPIM 0 1/4 09/30/24 EMTN | 4'400 | 0 | 4'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041568 | 0.0000 % KOROIL 0 10/04/24 GMTN | 4'400 | 500 | 4'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419041592 | 0.0000 % SOONVX 0 10/11/29 | 1'300 | 680 | 0 | 1'980 CHF | 92.35% | 1'828'530.00 | 0.08 | a) |
| CH0419041600 | 0.4000 % SOONVX 0.4 10/11/34 | 1'300 | 160 | 0 | 1'460 CHF | 89.00% | 1'299'400.00 | 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 CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0419041642 | 0.3000 % BNP 0.3 10/15/27 EMTN | 2'800 | 200 | 0 | 3'000 CHF | 94.80% | 2'844'000.00 | 0.12 | a) |
| CH0419041659 | 0.1525 % CMBNSW 0.1525 10/14/26 | 0 | 3'050 | 0 | 3'050 CHF | 95.95% | 2'926'475.00 | 0.12 | a) |
| CH0419041667 | 0.0700 % FABUH 0.07 10/18/27 EMTN | 1'300 | 600 | 1'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419042475 | 0.8750 % CMBNSW 0 7/8 06/08/26 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 98.05% | 1'568'800.00 | 0.07 | a) |
| CH0419042491 | 0.2500 % NESNVX 0 1/4 06/28/24 | 12'300 | 0 | 12'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0419042509 | 0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y | 8'700 | 2'400 | 0 | 11'100 CHF | 97.60% | 10'833'600.00 | 0.46 | a) |
| CH0423233557 | 0.5000 % DBHNGR 0 1/2 07/18/28 EMTN | 6'395 | 650 | 0 | 7'045 CHF | 96.50% | 6'798'425.00 | 0.29 | a) |
| CH0423279303 | 1.1000 % CMZB 1.1 07/11/25 EMTN | 1'600 | 0 | 0 | 1'600 CHF | 98.71% | 1'579'360.00 | 0.07 | a) |
| CH0425766513 | 0.6250 % SIKASW 0 5/8 07/12/24 | 0 | 3'200 | 3'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0425766521 | 1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28 | 0 | 1'550 | 0 | 1'550 CHF | 99.20% | 1'537'600.00 | 0.06 | a) |
| CH0425766539 | 0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN | 4'600 | 300 | 0 | 4'900 CHF | 97.55% | 4'779'950.00 | 0.20 | a) |
| CH0428194200 | 1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN | 2'550 | 0 | 2'550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0428194283 | 0.8750 % ADENVX 0 7/8 09/18/26 EMTN | 1'900 | 1'750 | 0 | 3'650 CHF | 98.30% | 3'587'950.00 | 0.15 | a) |
| CH0429659607 | 1.0000 % LLOYDS 1 03/04/25 EMTN | 6'100 | 0 | 0 | 6'100 CHF | 99.25% | 6'054'250.00 | 0.25 | a) |
| CH0433761274 | 1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24 | 5'300 | 400 | 5'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0433761308 | 0.2500 % ROSW 0 1/4 09/24/25 | 7'100 | 2'350 | 9'450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0433761316 | 0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30 | 4'300 | 200 | 4'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0434678352 | 1.1250 % BOBST 1 1/8 09/27/24 | 1'850 | 0 | 1'850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0435590358 | 0.7500 % BKWSW 0 3/4 10/15/25 | 0 | 6'450 | 0 | 6'450 CHF | 98.65% | 6'362'925.00 | 0.27 | a) |
| CH0437180935 | 0.7500 % SCMNXX 0 3/4 10/12/28 | 3'700 | 600 | 0 | 4'300 CHF | 97.25% | 4'181'750.00 | 0.18 | a) |
| CH0441186456 | 1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN | 1'200 | 1'000 | 0 | 2'200 CHF | 98.05% | 2'157'100.00 | 0.09 | a) |
| CH0441186522 | 0.6925 % BANCO 0.6925 12/04/24 EMTN | 1'600 | 1'000 | 2'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0446595610 | 0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN | 4'600 | 450 | 1'000 | 4'050 CHF | 98.90% | 4'005'450.00 | 0.17 | a) |
| CH0457206750 | 0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN | 3'350 | 600 | 3'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0457206800 | 0.3000 % ABBNVX 0.3 08/06/24 | 2'900 | 0 | 2'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0457206818 | 1.0000 % ABBNVX 1 05/07/29 | 3'350 | 750 | 0 | 4'100 CHF | 97.60% | 4'001'600.00 | 0.17 | a) |
| CH0458097976 | 0.5000 % BALHOL 0 1/2 11/28/25 | 2'900 | 0 | 2'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0459297419 | 0.5000 % BPCEGP 0 1/2 11/08/23 EMTN | 1'400 | 0 | 1'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0459297435 | 0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25 | 8'000 | 1'000 | 9'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0460054437 | 1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN | 2'285 | 500 | 2'785 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0461238856 | 0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN | 3'300 | 50 | 3'350 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0461238872 | 1.5000 % BOSUH 1 1/2 11/29/23 EMTN | 1'200 | 0 | 1'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0461238880 | 0.6000 % VBPSW 0.6 11/29/29 | 3'000 | 400 | 0 | 3'400 CHF | 92.55% | 3'146'700.00 | 0.13 | a) |
| CH0461238906 | 0.0000 % SLHNVX 0 06/06/25 EMTN | 4'400 | 400 | 0 | 4'800 CHF | 98.10% | 4'708'800.00 | 0.20 | a) |
| CH0461238914 | 0.3500 % SLHNVX 0.35 03/06/29 EMTN | 2'700 | 0 | 0 | 2'700 CHF | 93.85% | 2'533'950.00 | 0.11 | a) |
| CH0461238930 | 0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27 | 3'650 | 550 | 0 | 4'200 CHF | 95.25% | 4'000'500.00 | 0.17 | a) |
| CH0461238948 | 1.6250 % VORHYP 1 5/8 11/29/29 EMTN | 3'000 | 1'000 | 4'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0461239060 | 0.1500 % PSPNSW 0.15 02/02/29 | 2'100 | 0 | 0 | 2'100 CHF | 92.70% | 1'946'700.00 | 0.08 | a) |
| CH0461239094 | 0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN | 4'400 | 380 | 0 | 4'780 CHF | 93.25% | 4'457'350.00 | 0.19 | a) |
| CH0461239102 | 0.0000 % SWISSG 0 06/30/28 | 3'350 | 0 | 0 | 3'350 CHF | 94.00% | 3'149'000.00 | 0.13 | a) |
| CH0461239110 | 0.2000 % SWISSG 0.2 06/30/32 | 2'810 | 0 | 0 | 2'810 CHF | 89.30% | 2'509'330.00 | 0.11 | a) |
| CH0463112067 | 0.0500 % DNBNO 0.05 03/13/24 EMTN | 2'000 | 0 | 2'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0463112075 | 0.8750 % SOCGEN 0 7/8 02/28/24 EMTN | 2'200 | 0 | 2'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0465044623 | 0.3000 % BMW 0.3 09/05/24 EMTN | 4'650 | 0 | 4'650 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0465044631 | 0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN | 4'700 | 1'500 | 0 | 6'200 CHF | 97.90% | 6'069'800.00 | 0.26 | a) |
| CH0465044680 | 0.4010 % FABUH 0.401 10/02/24 EMTN | 1'900 | 250 | 2'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0465767769 | 1.0000 % ACAFP 1 11/07/25 EMTN | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 98.60% | 1'577'600.00 | 0.07 | a) |
| CH0467182405 | 0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN | 3'150 | 3'550 | 500 | 6'200 CHF | 98.15% | 6'085'300.00 | 0.26 | a) |
| CH0467182413 | 0.4500 % HTHROW 0.45 10/15/26 EMTN | 3'800 | 400 | 0 | 4'200 CHF | 96.70% | 4'061'400.00 | 0.17 | a) |
| CH0467182421 | 0.2500 % BFCM 0 1/4 07/10/25 EMTN | 2'150 | 0 | 0 | 2'150 CHF | 98.14% | 2'110'010.00 | 0.09 | a) |
| CH0468581571 | 1.0020 % AXPOSW 1.002 07/23/27 | 2'280 | 0 | 0 | 2'280 CHF | 97.45% | 2'221'860.00 | 0.09 | a) |
| CH0469273541 | 1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26 | 1'000 | 60 | 0 | 1'060 CHF | 98.55% | 1'044'630.00 | 0.04 | a) |
| CH0474178420 | 0.1250 % RAIFFS 0 1/8 05/07/24 | 1'300 | 0 | 1'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0474977672 | 0.1000 % HYNOE 0.1 11/27/24 EMTN | 1'600 | 250 | 1'850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0474977714 | 0.2050 % FABUH 0.205 12/04/25 EMTN | 1'650 | 250 | 1'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0474977722 | 0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN | 5'100 | 3'060 | 0 | 8'160 CHF | 97.05% | 7'919'280.00 | 0.33 | a) |
| CH0474977730 | 0.8000 % GRANDX 0.8 06/17/26 | 500 | 250 | 750 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0474977755 | 0.1250 % NONGNO 0 1/8 12/11/25 EMTN | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 97.40% | 1'217'500.00 | 0.05 | a) |
| CH0474977938 | 0.0000 % KORAIL 0 06/13/25 | 2'900 | 150 | 0 | 3'050 CHF | 97.81% | 2'983'205.00 | 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 CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0479222066 | 0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN | 1'900 | 200 | 0 | 2'100 CHF | 97.90% | 2'055'900.00 | 0.09 | a) |
| CH0479514264 | 0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN | 1'400 | 1'100 | 0 | 2'500 CHF | 96.65% | 2'416'250.00 | 0.10 | a) |
| CH0479514272 | 0.1000 % DBHNGR 0.1 06/19/29 EMTN | 5'700 | 350 | 0 | 6'050 CHF | 93.90% | 5'680'950.00 | 0.24 | a) |
| CH0479514280 | 0.5000 % DBHNGR 0 1/2 06/19/34 EMTN | 2'700 | 250 | 0 | 2'950 CHF | 91.20% | 2'690'400.00 | 0.11 | a) |
| CH0479514298 | 0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN | 3'200 | 600 | 0 | 3'800 CHF | 94.55% | 3'592'900.00 | 0.15 | a) |
| CH0479514314 | 0.2000 % KNINSW 0.2 06/18/25 | 2'680 | 0 | 0 | 2'680 CHF | 98.09% | 2'628'812.00 | 0.11 | a) |
| CH0481013800 | 0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29 | 3'100 | 350 | 0 | 3'450 CHF | 92.85% | 3'203'325.00 | 0.13 | a) |
| CH0482172357 | 0.1250 % NAB 0 1/8 06/21/27 EMTN | 2'650 | 250 | 0 | 2'900 CHF | 95.30% | 2'763'700.00 | 0.12 | a) |
| CH0482172407 | 0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29 | 1'600 | 400 | 0 | 2'000 CHF | 92.60% | 1'852'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0482172415 | 0.5700 % GYCGR 0.57 06/24/24 EMTN | 2'000 | 0 | 2'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0483180920 | 1.0000 % BANQUE 1 07/10/25 EMTN | 0 | 400 | 0 | 400 CHF | 98.23% | 392'920.00 | 0.02 | a) |
| CH0483180953 | 0.2000 % ORAFP 0.2 11/24/25 EMTN | 7'000 | 550 | 0 | 7'550 CHF | 97.80% | 7'383'900.00 | 0.31 | a) |
| CH0483180961 | 0.6250 % ORAFP 0 5/8 06/22/29 EMTN | 1'695 | 0 | 0 | 1'695 CHF | 95.45% | 1'617'877.50 | 0.07 | a) |
| CH0484360372 | 0.3750 % LGT 0 3/8 07/05/28 EMTN | 2'800 | 0 | 2'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0485445966 | 0.0500 % KOHNPW 0.05 07/19/27 EMTN | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 94.30% | 1'603'100.00 | 0.07 | a) |
| CH0487087295 | 0.2500 % BKWSW 0 1/4 07/29/27 | 0 | 2'530 | 0 | 2'530 CHF | 95.70% | 2'421'210.00 | 0.10 | a) |
| CH0487087337 | 0.1250 % VORHYP 0 1/8 09/03/29 EMTN | 3'000 | 1'700 | 4'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0488506665 | 0.0000 % PSPNSW 0 02/06/30 | 1'300 | 0 | 0 | 1'300 CHF | 90.50% | 1'176'500.00 | 0.05 | a) |
| CH0488506681 | 0.3750 % SPSNSW 0 3/8 09/30/31 | 3'850 | 650 | 0 | 4'500 CHF | 89.60% | 4'032'000.00 | 0.17 | a) |
| CH0494734335 | 0.0000 % SCMNVS 0 08/30/44 | 2'400 | 0 | 0 | 2'400 CHF | 70.95% | 1'702'800.00 | 0.07 | a) |
| CH0494734343 | 0.4500 % BANORT 0.45 12/18/23 | 2'000 | 0 | 2'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0494734426 | 0.1000 % ZUGNSW 0.1 10/02/25 | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 97.15% | 485'750.00 | 0.02 | a) |
| CH0496632628 | 0.1350 % BSANCI 0.135 08/29/29 EMTN | 0 | 500 | 0 | 500 CHF | 89.00% | 445'000.00 | 0.02 | a) |
| CH0496692978 | 0.0000 % BALHOL 0 09/25/26 | 2'100 | 1'750 | 3'850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0496692986 | 0.0000 % BALHOL 0 09/25/29 | 1'600 | 0 | 1'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0498400578 | 0.0500 % CM 0.05 10/15/26 EMTN | 5'700 | 600 | 0 | 6'300 CHF | 95.95% | 6'044'850.00 | 0.25 | a) |
| CH0498400586 | 0.1000 % CAABNK 0.1 10/23/23 | 1'500 | 0 | 1'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0498400602 | 0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN | 2'400 | 600 | 0 | 3'000 CHF | 95.90% | 2'877'000.00 | 0.12 | a) |
| CH0498589024 | 0.2500 % ACAFP 0 1/4 10/10/29 EMTN | 0 | 1'850 | 0 | 1'850 CHF | 92.00% | 1'702'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0502393389 | 0.1750 % RFLBOB 0.175 10/29/26 EMTN | 2'000 | 1'500 | 0 | 3'500 CHF | 95.25% | 3'333'750.00 | 0.14 | a) |
| CH0502393405 | 0.5000 % AMALEA 0 1/2 11/12/25 | 2'600 | 1'500 | 0 | 4'100 CHF | 97.90% | 4'013'900.00 | 0.17 | a) |
| CH0503144393 | 0.2500 % BFCM 0 1/4 10/24/29 EMTN | 2'500 | 0 | 0 | 2'500 CHF | 91.50% | 2'287'500.00 | 0.10 | a) |
| CH0503924414 | 0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN | 5'500 | 1'955 | 1'000 | 6'455 CHF | 94.60% | 6'106'430.00 | 0.26 | a) |
| CH0505011871 | 0.3750 % LGT 0 3/8 11/15/29 EMTN | 1'600 | 0 | 1'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0505011947 | 0.2000 % SANTAN 0.2 11/19/27 EMTN | 3'700 | 0 | 0 | 3'700 CHF | 94.40% | 3'492'800.00 | 0.15 | a) |
| CH0506071148 | 0.7750 % CLNXSM 0.775 02/18/27 EMTN | 800 | 0 | 0 | 800 CHF | 96.70% | 773'600.00 | 0.03 | a) |
| CH0506071205 | 0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN | 3'000 | 600 | 0 | 3'600 CHF | 93.20% | 3'355'200.00 | 0.14 | a) |
| CH0506071213 | 0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28 | 5'500 | 540 | 0 | 6'040 CHF | 94.10% | 5'683'640.00 | 0.24 | a) |
| CH0506071361 | 0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31 | 2'000 | 165 | 0 | 2'165 CHF | 89.90% | 1'946'335.00 | 0.08 | a) |
| CH0506071379 | 0.2500 % AMALEA 0 1/4 10/27/23 | 3'200 | 0 | 3'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0506668836 | 0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN | 3'400 | 30 | 0 | 3'430 CHF | 94.00% | 3'224'200.00 | 0.14 | a) |
| CH0508785737 | 0.1500 % SANSCF 0.15 12/10/24 EMTN | 2'500 | 350 | 2'850 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0512502995 | 0.1130 % CBAAU 0.113 12/10/29 EMTN | 2'300 | 3'000 | 0 | 5'300 CHF | 91.85% | 4'868'050.00 | 0.20 | a) |
| CH0515152467 | 0.1300 % SCMNVS 0.13 09/18/31 | 2'700 | 1'850 | 0 | 4'550 CHF | 90.40% | 4'113'200.00 | 0.17 | a) |
| CH0515152475 | 0.1600 % PSPNSW 0.16 09/16/31 | 2'000 | 0 | 0 | 2'000 CHF | 87.90% | 1'758'000.00 | 0.07 | a) |
| CH0515152483 | 0.4050 % RAIFFS 0.405 09/28/29 3 | 1'600 | 0 | 0 | 1'600 CHF | 91.90% | 1'470'400.00 | 0.06 | a) |
| CH0517825284 | 0.1275 % ACAFP 0.1275 07/27/28 EMTN | 0 | 3'200 | 0 | 3'200 CHF | 93.30% | 2'985'600.00 | 0.13 | a) |
| CH0517825292 | 0.2000 % BFCM 0.2 11/03/28 EMTN | 2'750 | 0 | 0 | 2'750 CHF | 92.90% | 2'554'750.00 | 0.11 | a) |
| CH0517825318 | 0.2600 % HYUCAP 0.26 02/11/25 EMTN | 0 | 4'170 | 1'500 | 2'670 CHF | 98.62% | 2'633'154.00 | 0.11 | a) |
| CH0517825326 | 0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN | 3'900 | 560 | 0 | 4'460 CHF | 92.90% | 4'143'340.00 | 0.17 | a) |
| CH0517825334 | 0.1000 % MUNHYP 0.1 12/17/25 EMTN | 3'600 | 800 | 0 | 4'400 CHF | 97.05% | 4'270'200.00 | 0.18 | a) |
| CH0519465170 | 0.1250 % AMALEA 0 1/8 02/12/24 | 950 | 0 | 950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0519933219 | 0.8000 % DB 0.8 02/07/25 EMTN | 3'200 | 0 | 1'600 | 1'600 CHF | 99.05% | 1'584'800.00 | 0.07 | a) |
| CH0520042513 | 0.5000 % BOBST 0 1/2 02/17/26 | 3'150 | 0 | 3'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0520663664 | 0.5000 % BANORT 0 1/2 12/06/24 | 2'950 | 500 | 3'450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0521333655 | 0.4350 % DT 0.435 02/06/32 EMTN | 5'200 | 500 | 5'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0521617339 | 0.2500 % SOCGEN 0 1/4 02/25/27 EMTN | 3'200 | 0 | 0 | 3'200 CHF | 95.25% | 3'048'000.00 | 0.13 | a) |
| CH0522158812 | 0.5000 % BNP 0 1/2 03/16/29 EMTN | 2'400 | 0 | 0 | 2'400 CHF | 92.25% | 2'214'000.00 | 0.09 | a) |
| CH0522158861 | 0.4000 % BCVAUD 0.4 05/05/36 | 2'000 | 1'500 | 3'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0522158887 | 0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN | 5'250 | 3'450 | 0 | 8'700 CHF | 89.60% | 7'795'200.00 | 0.33 | a) |
| CH0522158911 | 0.3850 % SUDAM 0.385 07/22/26 EMTN | 2'500 | 1'300 | 0 | 3'800 CHF | 95.75% | 3'638'500.00 | 0.15 | a) |
| CH0522158952 | 0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33 | 1'600 | 600 | 2'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0522159026 | 2.1000 % RENAUL 2.1 05/23/25 EMTN | 2'500 | 0 | 2'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0522690707 | 0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26 | 3'000 | 1'600 | 0 | 4'600 CHF | 95.90% | 4'411'400.00 | 0.19 | a) |
| CH0525158371 | 0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN | 3'900 | 250 | 0 | 4'150 CHF | 88.30% | 3'664'450.00 | 0.15 | a) |
| CH0525158421 | 0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN | 3'100 | 130 | 3'230 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0525158447 | 0.7000 % SYNNVX 0.7 12/09/26 | 2'650 | 30 | 0 | 2'680 CHF | 97.05% | 2'600'940.00 | 0.11 | a) |
| CH0525158462 | 0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN | 2'100 | 390 | 2'490 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536892570 | 0.4500 % SGSNVX 0.45 11/06/23 | 900 | 0 | 900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536892588 | 0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26 | 5'600 | 1'950 | 0 | 7'550 CHF | 98.35% | 7'425'425.00 | 0.31 | a) |
| CH0536892620 | 1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23 | 5'000 | 500 | 5'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536892828 | 1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27 | 1'700 | 1'050 | 0 | 2'750 CHF | 97.75% | 2'688'125.00 | 0.11 | a) |
| CH0536893230 | 0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30 | 2'900 | 750 | 0 | 3'650 CHF | 95.60% | 3'489'400.00 | 0.15 | a) |
| CH0536893255 | 0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30 | 2'400 | 600 | 0 | 3'000 CHF | 90.35% | 2'710'500.00 | 0.11 | a) |
| CH0536893271 | 0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28 | 3'400 | 900 | 4'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0536893339 | 0.1500 % SWISSG 0.15 06/30/34 | 1'300 | 0 | 0 | 1'300 CHF | 85.40% | 1'110'200.00 | 0.05 | a) |
| CH0538763514 | 0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25 | 2'900 | 1'350 | 0 | 4'250 CHF | 98.98% | 4'206'650.00 | 0.18 | a) |
| CH0539032950 | 0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN | 4'050 | 600 | 0 | 4'650 CHF | 98.65% | 4'587'225.00 | 0.19 | a) |
| CH0543827205 | 1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27 | 5'500 | 30 | 5'530 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0545766518 | 0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN | 1'600 | 850 | 2'450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0545766526 | 1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN | 2'600 | 1'550 | 4'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0545766534 | 0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN | 2'800 | 40 | 0 | 2'840 CHF | 96.65% | 2'744'860.00 | 0.12 | a) |
| CH0545766609 | 0.0500 % HILTI 0.05 07/02/25 | 2'150 | 1'000 | 0 | 3'150 CHF | 98.04% | 3'088'260.00 | 0.13 | a) |
| CH0547243268 | 0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25 | 3'650 | 600 | 0 | 4'250 CHF | 98.35% | 4'179'875.00 | 0.18 | a) |
| CH0547243276 | 0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28 | 4'500 | 1'710 | 0 | 6'210 CHF | 96.70% | 6'005'070.00 | 0.25 | a) |
| CH0550413394 | 0.5000 % ACAFP 0 1/2 10/01/26 EMTN | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 96.70% | 2'707'600.00 | 0.11 | a) |
| CH0551990689 | 0.5500 % STMNSW 0.55 10/03/25 | 2'900 | 0 | 0 | 2'900 CHF | 98.35% | 2'852'150.00 | 0.12 | a) |
| CH0553331809 | 1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25 | 4'740 | 1'450 | 0 | 6'190 CHF | 98.90% | 6'121'910.00 | 0.26 | a) |
| CH0553331817 | 0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26 | 2'700 | 1'200 | 3'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0553331825 | 0.5000 % BALHOL 0 1/2 12/16/30 | 1'700 | 0 | 1'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0553331890 | 0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27 | 1'370 | 250 | 0 | 1'620 CHF | 95.90% | 1'553'580.00 | 0.07 | a) |
| CH0554992070 | 0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN | 5'200 | 50 | 0 | 5'250 CHF | 95.55% | 5'016'375.00 | 0.21 | a) |
| CH0555837753 | 1.1175 % CLNXSM 1.1175 07/17/25 EMTN | 1'500 | 0 | 0 | 1'500 CHF | 98.70% | 1'480'500.00 | 0.06 | a) |
| CH0561923837 | 0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN | 4'550 | 1'000 | 0 | 5'550 CHF | 93.20% | 5'172'600.00 | 0.22 | a) |
| CH0561923845 | 0.8000 % SUNSW 0.8 09/23/25 | 0 | 3'300 | 0 | 3'300 CHF | 98.15% | 3'238'950.00 | 0.14 | a) |
| CH0561923852 | 0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN | 2'700 | 850 | 0 | 3'550 CHF | 92.95% | 3'299'725.00 | 0.14 | a) |
| CH0564642061 | 0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26 | 670 | 1'320 | 0 | 1'990 CHF | 96.70% | 1'924'330.00 | 0.08 | a) |
| CH0564642079 | 0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28 | 2'600 | 700 | 0 | 3'300 CHF | 93.85% | 3'097'050.00 | 0.13 | a) |
| CH0564642087 | 0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32 | 3'100 | 1'250 | 0 | 4'350 CHF | 90.60% | 3'941'100.00 | 0.17 | a) |
| CH0570576113 | 0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29 | 3'500 | 180 | 3'680 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0570576279 | 0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36 | 2'100 | 200 | 0 | 2'300 CHF | 84.85% | 1'951'550.00 | 0.08 | a) |
| CH0572142484 | 0.2000 % LGT 0.2 11/04/30 EMTN | 4'650 | 0 | 4'650 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0572327036 | 0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28 | 950 | 160 | 0 | 1'110 CHF | 93.75% | 1'040'625.00 | 0.04 | a) |
| CH0572899091 | 0.1825 % RAIFFS 0.1825 11/11/25 | 1'800 | 600 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0572899257 | 0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28 | 3'900 | 500 | 0 | 4'400 CHF | 93.60% | 4'118'400.00 | 0.17 | a) |
| CH0576402165 | 0.8750 % SUNSW 0 7/8 11/18/27 | 0 | 2'000 | 0 | 2'000 CHF | 96.30% | 1'926'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0580291968 | 0.2450 % SCMNVX 0.245 11/20/34 | 1'000 | 1'500 | 0 | 2'500 CHF | 87.55% | 2'188'750.00 | 0.09 | a) |
| CH0580464698 | 1.5000 % RAIFFS 1 1/2 11/23/34 | 2'300 | 0 | 0 | 2'300 CHF | 92.60% | 2'129'800.00 | 0.09 | a) |
| CH0581947733 | 0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29 | 5'800 | 550 | 0 | 6'350 CHF | 93.75% | 5'953'125.00 | 0.25 | a) |
| CH0581947808 | 0.1000 % DBHNGR 0.1 01/28/36 EMTN | 6'150 | 0 | 0 | 6'150 CHF | 85.40% | 5'252'100.00 | 0.22 | a) |
| CH0581947816 | 0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28 | 7'500 | 250 | 0 | 7'750 CHF | 94.85% | 7'350'875.00 | 0.31 | a) |
| CH0589030979 | 0.2500 % IRENSW 0 1/4 02/14/25 | 0 | 1'500 | 0 | 1'500 CHF | 98.40% | 1'476'000.00 | 0.06 | a) |
| CH0591084139 | 0.1775 % RAIFFS 0.1775 01/15/27 1 | 2'400 | 500 | 0 | 2'900 CHF | 95.75% | 2'776'750.00 | 0.12 | a) |
| CH0591084253 | 0.5700 % RAIFFS 0.57 01/15/31 | 3'200 | 1'400 | 0 | 4'600 CHF | 90.85% | 4'179'100.00 | 0.18 | a) |
| CH0593093211 | 0.1250 % KWOPER 0 1/8 02/21/31 | 2'300 | 40 | 0 | 2'340 CHF | 89.50% | 2'094'300.00 | 0.09 | a) |
| CH0593641027 | 0.3750 % SOCGEN 0 3/8 07/26/28 EMTN | 3'400 | 200 | 0 | 3'600 CHF | 93.10% | 3'351'600.00 | 0.14 | a) |
| CH0593641068 | 0.1500 % BALHOL 0.15 02/17/31 | 5'000 | 500 | 5'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0593893917 | 0.1250 % VORHYP 0 1/8 08/23/28 EMTN | 2'400 | 1'550 | 3'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH0593893925 | 0.0680 % FABUH 0.068 03/31/27 EMTN | 3'100 | 2'000 | 5'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH0593893990 | 0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31 | 3'150 | 590 | 0 | 3'740 CHF | 94.05% | 3'517'470.00 | 0.15 | a) |
| CH0593894006 | 0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN | 5'200 | 800 | 1'600 | 4'400 CHF | 94.65% | 4'164'600.00 | 0.17 | a) |
| CH0595205516 | 0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN | 1'500 | 500 | 0 | 2'000 CHF | 89.30% | 1'786'000.00 | 0.08 | a) |
| CH0598928718 | 0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29 | 5'000 | 2'400 | 0 | 7'400 CHF | 92.10% | 6'815'400.00 | 0.29 | a) |
| CH0598928726 | 0.2500 % ACAFP 0 1/4 03/10/31 EMTN | 0 | 3'400 | 0 | 3'400 CHF | 90.35% | 3'071'900.00 | 0.13 | a) |
| CH0598928742 | 0.2500 % BHH 0 1/4 03/10/31 EMTN | 2'200 | 350 | 0 | 2'550 CHF | 88.90% | 2'266'950.00 | 0.10 | a) |
| CH1101096555 | 0.1250 % BAER 0 1/8 04/27/28 | 4'100 | 2'300 | 0 | 6'400 CHF | 93.35% | 5'974'400.00 | 0.25 | a) |
| CH1101096613 | 0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27 | 1'000 | 40 | 0 | 1'040 CHF | 95.30% | 991'120.00 | 0.04 | a) |
| CH1101561525 | 0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27 | 2'800 | 160 | 0 | 2'960 CHF | 96.00% | 2'841'600.00 | 0.12 | a) |
| CH1104885954 | 0.9350 % CLNXSM 0.935 03/26/26 EMTN | 2'600 | 2'000 | 0 | 4'600 CHF | 97.95% | 4'505'700.00 | 0.19 | a) |
| CH1105672690 | 0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28 | 2'500 | 40 | 2'540 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1105672708 | 0.3750 % EFIAGC 0 3/8 05/06/26 | 1'390 | 650 | 0 | 2'040 CHF | 96.60% | 1'970'640.00 | 0.08 | a) |
| CH1108704839 | 0.8750 % TQLAU 0 7/8 11/19/31 EMTN | 3'000 | 800 | 0 | 3'800 CHF | 92.50% | 3'515'000.00 | 0.15 | a) |
| CH1111392887 | 0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28 | 2'900 | 3'550 | 0 | 6'450 CHF | 93.55% | 6'033'975.00 | 0.25 | a) |
| CH1112011536 | 0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN | 7'500 | 1'490 | 0 | 8'990 CHF | 94.40% | 8'486'560.00 | 0.36 | a) |
| CH1112011577 | 0.3100 % SANTAN 0.31 06/09/28 EMTN | 7'400 | 0 | 0 | 7'400 CHF | 94.25% | 6'974'500.00 | 0.29 | a) |
| CH1112011585 | 0.7500 % HIAGSW 0 3/4 06/30/28 | 0 | 3'100 | 0 | 3'100 CHF | 94.00% | 2'914'000.00 | 0.12 | a) |
| CH1112011593 | 0.4770 % CABKSM 0.477 07/01/27 EMTN | 3'400 | 1'600 | 0 | 5'000 CHF | 95.35% | 4'767'500.00 | 0.20 | a) |
| CH1112011601 | 0.3300 % BSANCI 0.33 06/22/27 EMTN | 0 | 3'150 | 0 | 3'150 CHF | 94.10% | 2'964'150.00 | 0.12 | a) |
| CH1112455766 | 0.2500 % SCMNVX 0 1/4 05/18/33 | 0 | 250 | 0 | 250 CHF | 89.10% | 222'750.00 | 0.01 | a) |
| CH1112455790 | 0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25 | 3'300 | 1'750 | 5'050 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1112455808 | 0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28 | 2'200 | 2'750 | 4'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1115424678 | 0.2000 % SFZZSW 0.2 06/15/26 | 3'400 | 150 | 3'550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1115424686 | 0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN | 4'200 | 4'000 | 1'000 | 7'200 CHF | 95.35% | 6'865'200.00 | 0.29 | a) |
| CH1115424702 | 0.2500 % BFCM 0 1/4 06/21/29 EMTN | 7'050 | 0 | 0 | 7'050 CHF | 92.00% | 6'486'000.00 | 0.27 | a) |
| CH1118223366 | 0.6000 % ALLNSW 0.6 07/15/30 | 4'900 | 250 | 5'150 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1118223382 | 1.0000 % GLRNKB 1 07/28/31 | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 93.90% | 2'629'200.00 | 0.11 | a) |
| CH1118223408 | 0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30 | 1'660 | 30 | 0 | 1'690 CHF | 91.55% | 1'547'195.00 | 0.07 | a) |
| CH1118223481 | 0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31 | 2'560 | 0 | 0 | 2'560 CHF | 88.90% | 2'275'840.00 | 0.10 | a) |
| CH1118223499 | 0.3000 % KSSTGA 0.3 09/30/36 | 2'120 | 50 | 0 | 2'170 CHF | 83.65% | 1'815'205.00 | 0.08 | a) |
| CH1118223523 | 0.0000 % ZURNVX 0 08/26/31 EMTN | 3'650 | 0 | 0 | 3'650 CHF | 88.70% | 3'237'550.00 | 0.14 | a) |
| CH1118460984 | 0.2125 % ACAFP 0.2125 06/21/29 EMTN | 0 | 2'850 | 0 | 2'850 CHF | 92.00% | 2'622'000.00 | 0.11 | a) |
| CH1118461008 | 0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN | 2'000 | 550 | 0 | 2'550 CHF | 93.05% | 2'372'775.00 | 0.10 | a) |
| CH1118483697 | 0.0519 % CAABNK 0.0519 12/20/24 | 4'300 | 500 | 4'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1118483747 | 0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN | 5'700 | 1'000 | 0 | 6'700 CHF | 94.10% | 6'304'700.00 | 0.26 | a) |
| CH1118483754 | 0.4500 % LGT 0.45 07/29/31 EMTN | 2'600 | 1'000 | 3'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1120085670 | 0.1500 % UBS 0.15 06/29/28 EMTN | 4'600 | 0 | 0 | 4'600 CHF | 93.65% | 4'307'900.00 | 0.18 | a) |
| CH1121837236 | 0.2000 % DLR 0.2 12/15/26 | 4'700 | 750 | 0 | 5'450 CHF | 95.10% | 5'182'950.00 | 0.22 | a) |
| CH1121837244 | 0.5500 % DLR 0.55 04/16/29 | 5'000 | 590 | 0 | 5'590 CHF | 91.40% | 5'109'260.00 | 0.21 | a) |
| CH1121837251 | 0.3025 % BNS 0.3025 07/30/31 EMTN | 4'900 | 350 | 0 | 5'250 CHF | 89.15% | 4'680'375.00 | 0.20 | a) |
| CH1125186663 | 0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN | 4'200 | 1'400 | 0 | 5'600 CHF | 94.50% | 5'292'000.00 | 0.22 | a) |
| CH1127263973 | 0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27 | 0 | 50 | 0 | 50 CHF | 95.40% | 47'700.00 | 0.00 | a) |
| CH1127263981 | 0.5000 % HOLNSW 0 1/2 08/26/31 | 2'200 | 700 | 0 | 2'900 CHF | 91.20% | 2'644'800.00 | 0.11 | a) |
| CH1129053786 | 0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29 | 700 | 50 | 0 | 750 CHF | 91.40% | 685'500.00 | 0.03 | a) |
| CH1129053802 | 0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN | 4'100 | 1'150 | 0 | 5'250 CHF | 91.85% | 4'822'125.00 | 0.20 | a) |
| CH1129053810 | 0.0500 % SWISSG 0.05 06/30/33 | 2'250 | 0 | 0 | 2'250 CHF | 86.20% | 1'939'500.00 | 0.08 | a) |
| CH1129053828 | 0.2000 % SWISSG 0.2 06/29/40 | 1'600 | 0 | 0 | 1'600 CHF | 77.40% | 1'238'400.00 | 0.05 | a) |
| CH1130818821 | 0.1750 % AMALEA 0.175 06/16/25 | 1'650 | 2'250 | 0 | 3'900 CHF | 97.90% | 3'818'100.00 | 0.16 | a) |
| CH1130818839 | 0.1250 % BALHOL 0 1/8 06/27/30 | 2'625 | 1'500 | 4'125 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1131931276 | 0.0000 % KSWINT 0 09/30/25 | 1'130 | 0 | 0 | 1'130 CHF | 97.60% | 1'102'880.00 | 0.05 | a) |
| CH1131931284 | 0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36 | 1'900 | 35 | 0 | 1'935 CHF | 83.60% | 1'617'660.00 | 0.07 | a) |
| CH1131931292 | 0.0000 % SWISSG 0 06/30/26 | 2'200 | 750 | 0 | 2'950 CHF | 96.65% | 2'851'175.00 | 0.12 | a) |
| CH1131931300 | 0.2500 % ALBAUZ 0 1/4 09/30/31 | 2'155 | 1'250 | 0 | 3'405 CHF | 89.60% | 3'050'880.00 | 0.13 | a) |
| CH1131931318 | 0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33 | 1'555 | 200 | 0 | 1'755 CHF | 87.40% | 1'533'870.00 | 0.06 | a) |
| CH1131931326 | 0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29 | 1'340 | 1'050 | 0 | 2'390 CHF | 91.45% | 2'185'655.00 | 0.09 | a) |
| CH1132966271 | 0.1250 % NONGNO 0 1/8 09/15/28 EMTN | 0 | 2'200 | 0 | 2'200 CHF | 92.20% | 2'028'400.00 | 0.09 | a) |
| CH1132966289 | 0.2000 % RY 0.2 09/22/31 EMTN | 3'050 | 0 | 0 | 3'050 CHF | 88.15% | 2'688'575.00 | 0.11 | a) |
| CH1132966347 | 0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29 | 6'540 | 60 | 0 | 6'600 CHF | 92.50% | 6'105'000.00 | 0.26 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1132966354 | 0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29 | 2'740 | 1'150 | 0 | 3'890 CHF | 92.40% | 3'594'360.00 | 0.15 | a) |
| CH1134691620 | 0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN | 2'600 | 1'800 | 0 | 4'400 CHF | 94.45% | 4'155'800.00 | 0.17 | a) |
| CH1135555584 | 0.2500 % ERSTBK 0 1/4 10/02/28 EMTN | 3'600 | 0 | 0 | 3'600 CHF | 91.90% | 3'308'400.00 | 0.14 | a) |
| CH1135555592 | 0.2500 % BHH 0 1/4 10/04/29 EMTN | 3'100 | 800 | 0 | 3'900 CHF | 91.35% | 3'562'650.00 | 0.15 | a) |
| CH1137122755 | 0.0500 % TECNSW 0.05 10/06/25 | 0 | 5'130 | 0 | 5'130 CHF | 97.65% | 5'009'445.00 | 0.21 | a) |
| CH1137122771 | 0.2500 % RY 0 1/4 10/15/29 EMTN | 2'400 | 150 | 0 | 2'550 CHF | 91.70% | 2'338'350.00 | 0.10 | a) |
| CH1137122789 | 1.1500 % TANNER 1.15 04/26/24 EMTN | 2'400 | 0 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1137122797 | 0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN | 4'750 | 200 | 0 | 4'950 CHF | 91.85% | 4'546'575.00 | 0.19 | a) |
| CH1137122813 | 0.1637 % ACAFP 0.1637 04/28/28 EMTN | 0 | 2'200 | 0 | 2'200 CHF | 93.75% | 2'062'500.00 | 0.09 | a) |
| CH1137122847 | 0.4180 % SUDAM 0.418 03/31/27 EMTN | 2'400 | 1'000 | 0 | 3'400 CHF | 94.50% | 3'213'000.00 | 0.14 | a) |
| CH1137407412 | 0.1800 % CM 0.18 04/20/29 | 4'200 | 1'650 | 0 | 5'850 CHF | 92.25% | 5'396'625.00 | 0.23 | a) |
| CH1137407420 | 0.1425 % BNS 0.1425 10/25/28 EMTN | 2'200 | 1'500 | 0 | 3'700 CHF | 92.75% | 3'431'750.00 | 0.14 | a) |
| CH1139995778 | 0.2100 % AMALEA 0.21 06/27/24 | 2'950 | 0 | 2'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1139995786 | 0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26 | 1'810 | 530 | 0 | 2'340 CHF | 96.10% | 2'248'740.00 | 0.09 | a) |
| CH1139995802 | 0.7500 % BICECL 0 3/4 10/29/26 EMTN | 2'200 | 0 | 0 | 2'200 CHF | 94.80% | 2'085'600.00 | 0.09 | a) |
| CH1141700414 | 0.4175 % CMBNSW 0.4175 11/15/28 | 0 | 5'420 | 0 | 5'420 CHF | 94.15% | 5'102'930.00 | 0.21 | a) |
| CH1141700547 | 0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26 | 5'400 | 2'530 | 0 | 7'930 CHF | 95.95% | 7'608'835.00 | 0.32 | a) |
| CH1142512347 | 0.5275 % BNP 0.5275 01/20/28 EMTN | 4'600 | 800 | 0 | 5'400 CHF | 94.55% | 5'105'700.00 | 0.21 | a) |
| CH1142512362 | 2.8925 % BNP 2.8925 09/27/29 EMTN | 3'600 | 400 | 0 | 4'000 CHF | 103.85% | 4'154'000.00 | 0.17 | a) |
| CH1142700363 | 0.2975 % BSANCI 0.2975 10/22/26 EMTN | 0 | 3'950 | 0 | 3'950 CHF | 95.25% | 3'762'375.00 | 0.16 | a) |
| CH1142754303 | 0.1500 % BFCM 0.15 03/06/28 EMTN | 3'000 | 250 | 0 | 3'250 CHF | 93.85% | 3'050'125.00 | 0.13 | a) |
| CH1142754329 | 0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN | 7'600 | 710 | 0 | 8'310 CHF | 92.95% | 7'724'145.00 | 0.32 | a) |
| CH1142754345 | 0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL | 2'750 | 1'710 | 0 | 4'460 CHF | 96.50% | 4'303'900.00 | 0.18 | a) |
| CH1145096140 | 0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN | 5'000 | 1'800 | 0 | 6'800 CHF | 95.00% | 6'460'000.00 | 0.27 | a) |
| CH1145096157 | 0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN | 5'400 | 800 | 0 | 6'200 CHF | 89.90% | 5'573'800.00 | 0.23 | a) |
| CH1145096165 | 0.4350 % UBS 0.435 11/09/28 | 8'200 | 800 | 0 | 9'000 CHF | 93.90% | 8'451'000.00 | 0.36 | a) |
| CH1145096181 | 0.1475 % FABUH 0.1475 11/17/26 EMTN | 2'400 | 0 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1146382481 | 0.3750 % EMMI 0 3/8 12/01/31 | 2'275 | 2'275 | 2'275 | 2'275 CHF | 91.50% | 2'081'625.00 | 0.09 | a) |
| CH1146382499 | 0.1875 % CBAAU 0.1875 12/08/28 EMTN | 5'500 | 250 | 0 | 5'750 CHF | 93.75% | 5'390'625.00 | 0.23 | a) |
| CH1148266195 | 0.6250 % SYNNAVX 0 5/8 08/30/24 | 2'400 | 0 | 2'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1148266203 | 0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN | 900 | 50 | 0 | 950 CHF | 93.05% | 883'975.00 | 0.04 | a) |
| CH1148266252 | 0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN | 3'300 | 600 | 0 | 3'900 CHF | 93.80% | 3'658'200.00 | 0.15 | a) |
| CH1148308724 | 0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27 | 4'970 | 50 | 0 | 5'020 CHF | 95.65% | 4'801'630.00 | 0.20 | a) |
| CH1148308732 | 0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30 | 2'715 | 550 | 0 | 3'265 CHF | 92.95% | 3'034'817.50 | 0.13 | a) |
| CH1148308740 | 0.3625 % BZLNZ 0.3625 12/14/29 GMTN | 5'600 | 0 | 0 | 5'600 CHF | 92.15% | 5'160'400.00 | 0.22 | a) |
| CH1148728194 | 0.7500 % ZUGNSW 0 3/4 04/17/29 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 94.40% | 1'510'400.00 | 0.06 | a) |
| CH1148728210 | 0.3000 % BALHOL 0.3 02/16/27 | 2'600 | 0 | 2'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1151526212 | 0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN | 5'200 | 2'000 | 0 | 7'200 CHF | 95.90% | 6'904'800.00 | 0.29 | a) |
| CH1154887116 | 0.4100 % ACAFP 0.41 01/18/30 EMTN | 0 | 1'250 | 0 | 1'250 CHF | 92.05% | 1'150'625.00 | 0.05 | a) |
| CH1154887140 | 1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32 | 1'200 | 100 | 0 | 1'300 CHF | 94.25% | 1'225'250.00 | 0.05 | a) |
| CH1154887157 | 0.6025 % LLOYDS 0.6025 02/09/29 EMTN | 3'600 | 0 | 0 | 3'600 CHF | 93.20% | 3'355'200.00 | 0.14 | a) |
| CH1159841332 | 0.2800 % SOCGEN 0.28 01/26/27 EMTN | 1'650 | 1'000 | 0 | 2'650 CHF | 95.90% | 2'541'350.00 | 0.11 | a) |
| CH1159841340 | 0.7450 % SOCGEN 0.745 01/26/29 EMTN | 2'200 | 1'200 | 600 | 2'800 CHF | 93.30% | 2'612'400.00 | 0.11 | a) |
| CH1160188319 | 0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN | 2'600 | 600 | 0 | 3'200 CHF | 95.10% | 3'043'200.00 | 0.13 | a) |
| CH1160188327 | 0.5650 % NAB 0.565 02/03/31 EMTN | 1'750 | 300 | 0 | 2'050 CHF | 93.55% | 1'917'775.00 | 0.08 | a) |
| CH1160188335 | 0.2500 % AXPOSW 0 1/4 02/04/25 | 4'000 | 0 | 2'000 | 2'000 CHF | 98.62% | 1'972'400.00 | 0.08 | a) |
| CH1160188343 | 0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27 | 5'000 | 800 | 0 | 5'800 CHF | 97.00% | 5'626'000.00 | 0.24 | a) |
| CH1160382904 | 0.5600 % ITAU 0.56 02/17/25 | 1'950 | 0 | 1'000 | 950 CHF | 98.60% | 936'700.00 | 0.04 | a) |
| CH1160382979 | 1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN | 3'400 | 850 | 0 | 4'250 CHF | 97.25% | 4'133'125.00 | 0.17 | a) |
| CH1160680166 | 0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN | 1'400 | 1'200 | 0 | 2'600 CHF | 96.95% | 2'520'700.00 | 0.11 | a) |
| CH1163572915 | 0.3750 % BHH 0 3/8 02/21/25 EMTN | 1'600 | 0 | 1'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1164800661 | 0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29 | 1'500 | 50 | 0 | 1'550 CHF | 94.75% | 1'468'625.00 | 0.06 | a) |
| CH1166151899 | 0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27 | 12'900 | 1'500 | 14'400 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1166151907 | 0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31 | 9'900 | 3'200 | 13'100 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1166151915 | 1.0000 % ROSW 1 02/25/37 | 5'300 | 1'000 | 6'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1167887277 | 0.8975 % NWG 0.8975 04/04/25 EMTN | 4'600 | 1'200 | 0 | 5'800 CHF | 99.11% | 5'748'380.00 | 0.24 | a) |
| CH1168499775 | 0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27 | 6'700 | 3'050 | 0 | 9'750 CHF | 97.85% | 9'540'375.00 | 0.40 | a) |
| CH1168499817 | 0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27 | 1'200 | 20 | 0 | 1'220 CHF | 97.70% | 1'191'940.00 | 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 CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1170565712 | 1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN | 6'300 | 2'300 | 0 | 8'600 CHF | 97.85% | 8'415'100.00 | 0.35 | a) |
| CH1170565761 | 1.5500 % BELLSW 1.55 05/16/29 | 0 | 4'800 | 0 | 4'800 CHF | 98.55% | 4'730'400.00 | 0.20 | a) |
| CH1172972825 | 1.7700 % HIAGSW 1.77 10/30/26 | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 99.35% | 1'688'950.00 | 0.07 | a) |
| CH1175016109 | 1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26 | 4'400 | 1'050 | 0 | 5'450 CHF | 99.60% | 5'428'200.00 | 0.23 | a) |
| CH1175016125 | 1.7000 % DLR 1.7 03/30/27 | 2'500 | 1'000 | 0 | 3'500 CHF | 98.55% | 3'449'250.00 | 0.14 | a) |
| CH1179184390 | 0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26 | 0 | 3'100 | 0 | 3'100 CHF | 98.60% | 3'056'600.00 | 0.13 | a) |
| CH1179184408 | 1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29 | 0 | 1'700 | 0 | 1'700 CHF | 97.60% | 1'659'200.00 | 0.07 | a) |
| CH1179534933 | 1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29 | 3'700 | 20 | 0 | 3'720 CHF | 97.85% | 3'640'020.00 | 0.15 | a) |
| CH1179534941 | 1.4000 % SOONVX 1.4 02/19/32 | 5'500 | 1'250 | 0 | 6'750 CHF | 98.75% | 6'665'625.00 | 0.28 | a) |
| CH1179534966 | 1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29 | 3'300 | 600 | 3'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1179534974 | 1.4500 % RY 1.45 05/04/27 EMTN | 3'000 | 500 | 0 | 3'500 CHF | 99.30% | 3'475'500.00 | 0.15 | a) |
| CH1181713616 | 1.0625 % FABUH 1.0625 04/14/26 EMTN | 2'300 | 150 | 2'450 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1181713640 | 1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN | 2'800 | 2'000 | 0 | 4'800 CHF | 97.40% | 4'675'200.00 | 0.20 | a) |
| CH1182086848 | 1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37 | 3'000 | 2'050 | 0 | 5'050 CHF | 97.85% | 4'941'425.00 | 0.21 | a) |
| CH1184694714 | 1.2500 % SHBASS 1 1/4 05/24/27 EMTN | 0 | 6'700 | 0 | 6'700 CHF | 98.95% | 6'629'650.00 | 0.28 | a) |
| CH1184694722 | 1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27 | 2'800 | 1'310 | 0 | 4'110 CHF | 100.10% | 4'114'110.00 | 0.17 | a) |
| CH1184694730 | 1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN | 3'400 | 2'300 | 0 | 5'700 CHF | 98.40% | 5'608'800.00 | 0.24 | a) |
| CH1184694755 | 1.6250 % ALPHSW 1 5/8 05/30/25 | 3'400 | 750 | 0 | 4'150 CHF | 99.71% | 4'137'965.00 | 0.17 | a) |
| CH1184694763 | 1.3275 % SANTAN 1.3275 06/10/25 EMTN | 3'200 | 1'750 | 0 | 4'950 CHF | 99.62% | 4'931'190.00 | 0.21 | a) |
| CH1184694789 | 1.5000 % MINGNO 1 1/2 06/15/27 EMTN | 0 | 3'500 | 0 | 3'500 CHF | 99.35% | 3'477'250.00 | 0.15 | a) |
| CH1187450817 | 1.5000 % BFCM 1 1/2 06/01/27 EMTN | 2'300 | 1'200 | 0 | 3'500 CHF | 99.30% | 3'475'500.00 | 0.15 | a) |
| CH1187520460 | 1.4604 % ACAFP 1.4604 07/01/27 EMTN | 0 | 3'300 | 0 | 3'300 CHF | 99.05% | 3'268'650.00 | 0.14 | a) |
| CH1187520486 | 1.8780 % HYUCAP 1.878 06/14/27 EMTN | 0 | 2'400 | 0 | 2'400 CHF | 100.15% | 2'403'600.00 | 0.10 | a) |
| CH1187520494 | 1.8050 % HSBC 1.805 06/01/26 EMTN | 2'600 | 600 | 0 | 3'200 CHF | 99.55% | 3'185'600.00 | 0.13 | a) |
| CH1189217735 | 1.1833 % CMBNSW 1.1833 11/27/25 | 0 | 4'900 | 0 | 4'900 CHF | 99.05% | 4'853'450.00 | 0.20 | a) |
| CH1189217743 | 1.0000 % SFSNSW 1 06/06/25 | 0 | 4'150 | 0 | 4'150 CHF | 99.22% | 4'117'630.00 | 0.17 | a) |
| CH1189217750 | 1.4500 % SFSNSW 1.45 06/08/27 | 0 | 3'490 | 0 | 3'490 CHF | 99.45% | 3'470'805.00 | 0.15 | a) |
| CH1189217768 | 1.7000 % KTSPL 1.7 06/24/32 | 2'000 | 2'000 | 2'000 | 2'000 CHF | 100.10% | 2'002'000.00 | 0.08 | a) |
| CH1189217784 | 1.1000 % SWISSG 1.1 06/30/27 | 2'800 | 600 | 0 | 3'400 CHF | 98.80% | 3'359'200.00 | 0.14 | a) |
| CH1189217818 | 1.5000 % AARELE 1 1/2 06/29/29 | 0 | 2'300 | 0 | 2'300 CHF | 99.40% | 2'286'200.00 | 0.10 | a) |
| CH1189217867 | 2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27 | 4'400 | 1'000 | 0 | 5'400 CHF | 101.50% | 5'481'000.00 | 0.23 | a) |
| CH1189217990 | 1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25 | 2'625 | 30 | 0 | 2'655 CHF | 99.50% | 2'641'725.00 | 0.11 | a) |
| CH1189218006 | 1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29 | 6'780 | 4'100 | 0 | 10'880 CHF | 100.35% | 10'918'080.00 | 0.46 | a) |
| CH1191066252 | 2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27 | 4'000 | 605 | 0 | 4'605 CHF | 100.25% | 4'616'512.50 | 0.19 | a) |
| CH1191714703 | 1.1250 % GIVNVX 1 1/8 06/15/26 | 1'660 | 1'510 | 0 | 3'170 CHF | 99.05% | 3'139'885.00 | 0.13 | a) |
| CH1191714711 | 1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29 | 3'050 | 1'750 | 0 | 4'800 CHF | 100.35% | 4'816'800.00 | 0.20 | a) |
| CH1194000316 | 1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN | 3'800 | 600 | 0 | 4'400 CHF | 100.05% | 4'402'200.00 | 0.18 | a) |
| CH1194000324 | 1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26 | 4'050 | 500 | 0 | 4'550 CHF | 99.65% | 4'534'075.00 | 0.19 | a) |
| CH1194000332 | 1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29 | 2'650 | 800 | 0 | 3'450 CHF | 101.40% | 3'498'300.00 | 0.15 | a) |
| CH1194355108 | 1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26 | 9'800 | 1'800 | 0 | 11'600 CHF | 100.65% | 11'675'400.00 | 0.49 | a) |
| CH1194355116 | 2.1250 % NESNVX 2 1/8 07/15/30 | 7'600 | 5'695 | 1'500 | 11'795 CHF | 104.55% | 12'331'672.50 | 0.52 | a) |
| CH1194355124 | 2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34 | 6'200 | 1'600 | 0 | 7'800 CHF | 109.75% | 8'560'500.00 | 0.36 | a) |
| CH1196217009 | 1.8750 % ELEKTR 1 7/8 09/23/26 | 2'790 | 0 | 0 | 2'790 CHF | 100.45% | 2'802'555.00 | 0.12 | a) |
| CH1196217017 | 2.6250 % HRENSW 2 5/8 07/15/37 | 1'300 | 2'300 | 1'800 | 1'800 CHF | 105.40% | 1'897'200.00 | 0.08 | a) |
| CH1199322350 | 1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28 | 2'900 | 50 | 2'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1202242264 | 3.8450 % DZBK 3.845 08/17/32 EMTN | 3'400 | 1'200 | 0 | 4'600 CHF | 102.70% | 4'724'200.00 | 0.20 | a) |
| CH1204175124 | 1.9150 % NWIDE 1.915 09/08/28 EMTN | 6'200 | 250 | 0 | 6'450 CHF | 100.10% | 6'456'450.00 | 0.27 | a) |
| CH1204259779 | 2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26 | 5'200 | 2'350 | 0 | 7'550 CHF | 100.70% | 7'602'850.00 | 0.32 | a) |
| CH1204259787 | 2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29 | 3'400 | 1'050 | 0 | 4'450 CHF | 102.80% | 4'574'600.00 | 0.19 | a) |
| CH1204259811 | 1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN | 5'200 | 1'300 | 0 | 6'500 CHF | 104.50% | 6'792'500.00 | 0.29 | a) |
| CH1206367380 | 1.5000 % GEBNVX 1 1/2 09/14/26 | 4'100 | 0 | 0 | 4'100 CHF | 100.20% | 4'108'200.00 | 0.17 | a) |
| CH1206367398 | 1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29 | 3'420 | 915 | 0 | 4'335 CHF | 101.70% | 4'408'695.00 | 0.19 | a) |
| CH1206367430 | 2.2000 % GVAERO 2.2 09/22/26 | 2'100 | 250 | 0 | 2'350 CHF | 101.45% | 2'384'075.00 | 0.10 | a) |
| CH1206367463 | 1.9500 % GROUPE 1.95 09/30/27 | 2'400 | 0 | 0 | 2'400 CHF | 101.05% | 2'425'200.00 | 0.10 | a) |
| CH1206367471 | 2.5500 % GROUPE 2.55 09/30/32 | 2'000 | 280 | 0 | 2'280 CHF | 105.95% | 2'415'660.00 | 0.10 | a) |
| CH1206367497 | 3.7500 % DOKASW 3 3/4 10/14/27 | 5'100 | 500 | 0 | 5'600 CHF | 105.70% | 5'919'200.00 | 0.25 | a) |
| CH1206367554 | 3.1125 % CMBNSW 3.1125 04/28/27 | 0 | 2'150 | 0 | 2'150 CHF | 103.95% | 2'234'925.00 | 0.09 | a) |
| CH1206367604 | 2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26 | 5'280 | 1'400 | 6'680 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1206367661 | 2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29 | 4'200 | 1'350 | 5'550 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1210198144 | 2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27 | 4'300 | 2'560 | 0 | 6'860 CHF | 102.20% | 7'010'920.00 | 0.29 | a) |
| CH1211713222 | 1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26 | 9'800 | 200 | 10'000 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1211713230 | 2.0000 % ROSW 2 09/23/32 | 6'500 | 1'000 | 7'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1211713248 | 3.2500 % AMALEA 3 1/4 09/22/27 | 3'100 | 0 | 0 | 3'100 CHF | 103.30% | 3'202'300.00 | 0.13 | a) |
| CH1212189158 | 2.7500 % LGT 2 3/4 09/29/32 EMTN | 3'800 | 500 | 4'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1213243913 | 3.0425 % ACAFP 3.0425 09/29/27 EMTN | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 103.80% | 2'906'400.00 | 0.12 | a) |
| CH1214797180 | 2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25 | 3'200 | 250 | 0 | 3'450 CHF | 100.80% | 3'477'600.00 | 0.15 | a) |
| CH1214797198 | 2.3750 % ABBNVX 2 3/8 04/05/30 | 2'400 | 250 | 0 | 2'650 CHF | 104.95% | 2'781'175.00 | 0.12 | a) |
| CH1214797206 | 2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN | 5'130 | 850 | 0 | 5'980 CHF | 102.05% | 6'102'590.00 | 0.26 | a) |
| CH1214797214 | 2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN | 1'900 | 1'800 | 0 | 3'700 CHF | 101.85% | 3'768'450.00 | 0.16 | a) |
| CH1215933958 | 3.3750 % CMZB 3 3/8 09/29/26 EMTN | 2'300 | 200 | 0 | 2'500 CHF | 102.90% | 2'572'500.00 | 0.11 | a) |
| CH1216400049 | 2.8700 % BAWAG 2.87 10/03/25 | 3'000 | 0 | 0 | 3'000 CHF | 101.30% | 3'039'000.00 | 0.13 | a) |
| CH1218301971 | 2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN | 1'600 | 30 | 0 | 1'630 CHF | 102.10% | 1'664'230.00 | 0.07 | a) |
| CH1221150506 | 1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/07/25 | 5'200 | 3'750 | 4'000 | 4'950 CHF | 100.40% | 4'969'800.00 | 0.21 | a) |
| CH1223665063 | 3.3500 % SUNSW 3.35 11/16/26 | 0 | 2'280 | 0 | 2'280 CHF | 103.70% | 2'364'360.00 | 0.10 | a) |
| CH1226543838 | 2.2500 % NESNVX 2 1/4 11/08/29 | 5'400 | 2'750 | 2'000 | 6'150 CHF | 104.75% | 6'442'125.00 | 0.27 | a) |
| CH1226543846 | 2.6250 % NESNVX 2 5/8 11/08/35 | 3'800 | 1'750 | 0 | 5'550 CHF | 111.90% | 6'210'450.00 | 0.26 | a) |
| CH1226543861 | 1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25 | 0 | 4'150 | 0 | 4'150 CHF | 100.45% | 4'168'675.00 | 0.18 | a) |
| CH1226543879 | 2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28 | 0 | 8'800 | 1'000 | 7'800 CHF | 103.40% | 8'065'200.00 | 0.34 | a) |
| CH1227937690 | 1.8600 % EOANGR 1.86 12/05/25 EMTN | 2'800 | 750 | 0 | 3'550 CHF | 100.30% | 3'560'650.00 | 0.15 | a) |
| CH1227937708 | 2.5025 % EOANGR 2.5025 12/05/29 EMTN | 2'500 | 0 | 0 | 2'500 CHF | 104.80% | 2'620'000.00 | 0.11 | a) |
| CH1227937716 | 2.4125 % BNP 2.4125 01/13/28 EMTN | 5'000 | 1'800 | 0 | 6'800 CHF | 102.55% | 6'973'400.00 | 0.29 | a) |
| CH1227937724 | 2.2475 % SANTAN 2.2475 01/30/26 EMTN | 4'100 | 500 | 0 | 4'600 CHF | 101.05% | 4'648'300.00 | 0.20 | a) |
| CH1228837865 | 2.3300 % UBS 2.33 11/14/25 | 4'800 | 1'000 | 0 | 5'800 CHF | 101.15% | 5'866'700.00 | 0.25 | a) |
| CH1228837899 | 2.4075 % BBVASM 2.4075 11/28/25 GMTN | 3'300 | 1'000 | 0 | 4'300 CHF | 101.25% | 4'353'750.00 | 0.18 | a) |
| CH1228837907 | 2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN | 3'400 | 100 | 0 | 3'500 CHF | 104.45% | 3'655'750.00 | 0.15 | a) |
| CH1228838129 | 2.2850 % DBHNGR 2.285 11/28/42 EMTN | 2'300 | 1'100 | 0 | 3'400 CHF | 113.15% | 3'847'100.00 | 0.16 | a) |
| CH1230759479 | 2.5500 % REPISW 2.55 12/09/24 | 2'000 | 1'250 | 3'250 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1230759487 | 3.1000 % AKEB 3.1 12/19/25 | 3'900 | 1'500 | 0 | 5'400 CHF | 101.80% | 5'497'200.00 | 0.23 | a) |
| CH1230759503 | 1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30 | 3'280 | 1'400 | 0 | 4'680 CHF | 102.65% | 4'804'020.00 | 0.20 | a) |
| CH1230759552 | 2.4450 % RY 2.445 01/25/28 EMTN | 3'400 | 700 | 0 | 4'100 CHF | 102.60% | 4'206'600.00 | 0.18 | a) |
| CH1230759560 | 1.9500 % INSBER 1.95 05/07/26 | 4'300 | 250 | 0 | 4'550 CHF | 100.85% | 4'588'675.00 | 0.19 | a) |
| CH1231312690 | 2.1900 % ACAFP 2.19 12/07/27 EMTN | 0 | 2'600 | 0 | 2'600 CHF | 101.50% | 2'639'000.00 | 0.11 | a) |
| CH1231312708 | 2.7825 % NWG 2.7825 12/06/27 EMTN | 3'800 | 800 | 0 | 4'600 CHF | 103.10% | 4'742'600.00 | 0.20 | a) |
| CH1231312716 | 2.1500 % KOROIL 2.15 12/19/24 | 1'900 | 0 | 1'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1232107057 | 2.0000 % VAHNSW 2 12/08/27 | 1'600 | 1'000 | 0 | 2'600 CHF | 101.45% | 2'637'700.00 | 0.11 | a) |
| CH1232107164 | 2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26 | 1'600 | 1'300 | 0 | 2'900 CHF | 100.70% | 2'920'300.00 | 0.12 | a) |
| CH1232107180 | 2.2000 % BALHOL 2.2 01/30/32 | 3'200 | 0 | 3'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1233900013 | 2.3750 % VORHYP 2 3/8 05/04/26 EMTN | 2'300 | 0 | 2'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1236363425 | 2.4875 % RABOBK 2.4875 01/25/29 GMTN | 2'800 | 200 | 0 | 3'000 CHF | 102.10% | 3'063'000.00 | 0.13 | a) |
| CH1236363433 | 2.0400 % SLHNVX 2.04 01/26/26 | 3'360 | 400 | 0 | 3'760 CHF | 100.80% | 3'790'080.00 | 0.16 | a) |
| CH1239464691 | 3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28 | 0 | 3'950 | 3'950 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1239464709 | 2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28 | 0 | 8'500 | 0 | 8'500 CHF | 102.75% | 8'733'750.00 | 0.37 | a) |
| CH1239464774 | 2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29 | 0 | 2'680 | 0 | 2'680 CHF | 103.70% | 2'779'160.00 | 0.12 | a) |
| CH1239464808 | 2.0000 % PSPNSW 2 07/01/26 JUN | 0 | 1'300 | 1'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1239464816 | 2.2500 % PSPNSW 2 1/4 10/02/28 | 0 | 3'700 | 0 | 3'700 CHF | 102.05% | 3'775'850.00 | 0.16 | a) |
| CH1239495042 | 3.0325 % HYUCAP 3.0325 02/01/28 | 0 | 2'065 | 0 | 2'065 CHF | 104.20% | 2'151'730.00 | 0.09 | a) |
| CH1242301278 | 2.2588 % SLHNVX 2.2588 07/26/28 | 3'550 | 1'400 | 0 | 4'950 CHF | 102.70% | 5'083'650.00 | 0.21 | a) |
| CH1242301286 | 2.6100 % SLHNVX 2.61 01/26/32 | 3'450 | 950 | 0 | 4'400 CHF | 106.45% | 4'683'800.00 | 0.20 | a) |
| CH1242969199 | 2.3000 % BFCM 2.3 01/30/27 EMTN | 4'200 | 400 | 0 | 4'600 CHF | 101.60% | 4'673'600.00 | 0.20 | a) |
| CH1243018806 | 2.7450 % LLOYDS 2.745 02/02/27 EMTN | 3'800 | 1'600 | 0 | 5'400 CHF | 101.25% | 5'467'500.00 | 0.23 | a) |
| CH1243018814 | 2.2600 % BMO 2.26 02/01/29 EMTN | 3'500 | 200 | 0 | 3'700 CHF | 102.45% | 3'790'650.00 | 0.16 | a) |
| CH1243018822 | 2.8025 % AMALEA 2.8025 09/10/25 | 3'600 | 0 | 0 | 3'600 CHF | 101.00% | 3'636'000.00 | 0.15 | a) |
| CH1243018830 | 3.0850 % AMALEA 3.085 02/10/28 | 2'200 | 1'250 | 0 | 3'450 CHF | 103.05% | 3'555'225.00 | 0.15 | a) |
| CH1243651903 | 2.4113 % CMBNSW 2.4113 08/08/29 | 0 | 3'000 | 0 | 3'000 CHF | 102.55% | 3'076'500.00 | 0.13 | a) |
| CH1243651929 | 2.5000 % LGT 2 1/2 02/28/33 EMTN | 4'300 | 1'500 | 5'800 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1243651937 | 2.3500 % KWLILI 2.35 03/01/27 | 1'500 | 2'200 | 0 | 3'700 CHF | 101.90% | 3'770'300.00 | 0.16 | a) |
| CH1243651945 | 2.7500 % KWLILI 2 3/4 03/01/30 | 2'430 | 1'920 | 0 | 4'350 CHF | 105.50% | 4'589'250.00 | 0.19 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1243651994 | 2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29 | 5'800 | 4'160 | 0 | 9'960 CHF | 101.30% | 10'089'480.00 | 0.42 | a) |
| CH1243933558 | 2.2025 % TD 2.2025 01/31/28 EMTN | 3'500 | 2'000 | 1'000 | 4'500 CHF | 101.60% | 4'572'000.00 | 0.19 | a) |
| CH1243933566 | 3.1300 % HIAGSW 3.13 02/16/29 | 0 | 1'200 | 0 | 1'200 CHF | 104.00% | 1'248'000.00 | 0.05 | a) |
| CH1244319450 | 3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN | 5'200 | 200 | 0 | 5'400 CHF | 102.95% | 5'559'300.00 | 0.23 | a) |
| CH1244321761 | 2.6300 % BNP 2.63 06/07/29 EMTN | 0 | 5'200 | 1'000 | 4'200 CHF | 104.25% | 4'378'500.00 | 0.18 | a) |
| CH1244321787 | 2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN | 0 | 2'850 | 0 | 2'850 CHF | 101.35% | 2'888'475.00 | 0.12 | a) |
| CH1244321795 | 2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN | 0 | 3'800 | 0 | 3'800 CHF | 103.40% | 3'929'200.00 | 0.17 | a) |
| CH1244731753 | 2.6250 % DZBK 2 5/8 08/27/29 EMTN | 2'400 | 1'600 | 1'000 | 3'000 CHF | 102.10% | 3'063'000.00 | 0.13 | a) |
| CH1244731795 | 2.1250 % BHH 2 1/8 02/27/26 EMTN | 3'000 | 1'000 | 0 | 4'000 CHF | 100.80% | 4'032'000.00 | 0.17 | a) |
| CH1245295758 | 3.2625 % CMZB 3.2625 02/03/27 EMTN | 3'500 | 1'200 | 0 | 4'700 CHF | 101.90% | 4'789'300.00 | 0.20 | a) |
| CH1248666930 | 1.8750 % SCMNVX 1 7/8 08/23/30 | 2'520 | 1'000 | 0 | 3'520 CHF | 102.85% | 3'620'320.00 | 0.15 | a) |
| CH1248666948 | 2.2775 % SOCGEN 2.2775 02/27/26 EMTN | 3'000 | 300 | 0 | 3'300 CHF | 101.10% | 3'336'300.00 | 0.14 | a) |
| CH1248666955 | 2.6175 % SOCGEN 2.6175 02/27/30 EMTN | 4'500 | 900 | 0 | 5'400 CHF | 103.40% | 5'583'600.00 | 0.23 | a) |
| CH1249416004 | 2.5413 % ACAFP 2.5413 09/03/30 EMTN | 0 | 900 | 0 | 900 CHF | 104.40% | 939'600.00 | 0.04 | a) |
| CH1249416012 | 2.7000 % NONGNO 2.7 03/20/29 EMTN | 0 | 3'200 | 0 | 3'200 CHF | 102.20% | 3'270'400.00 | 0.14 | a) |
| CH1249416079 | 2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25 | 0 | 6'340 | 0 | 6'340 CHF | 101.05% | 6'406'570.00 | 0.27 | a) |
| CH1249416087 | 2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32 | 0 | 6'270 | 0 | 6'270 CHF | 106.25% | 6'661'875.00 | 0.28 | a) |
| CH1251030099 | 2.6250 % ABNANV 2 5/8 03/02/28 EMTN | 5'200 | 2'000 | 0 | 7'200 CHF | 101.90% | 7'336'800.00 | 0.31 | a) |
| CH1251030115 | 2.5025 % ASBBNK 2.5025 12/20/28 EMTN | 4'200 | 900 | 0 | 5'100 CHF | 103.30% | 5'268'300.00 | 0.22 | a) |
| CH1251030123 | 3.1250 % ALPHSW 3 1/8 04/29/27 | 0 | 4'750 | 0 | 4'750 CHF | 103.70% | 4'925'750.00 | 0.21 | a) |
| CH1251030131 | 3.3750 % ALPHSW 3 3/8 04/29/30 | 0 | 4'100 | 0 | 4'100 CHF | 107.95% | 4'425'950.00 | 0.19 | a) |
| CH1251998220 | 2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30 | 0 | 2'055 | 2'055 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1253456078 | 2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26 | 0 | 4'200 | 0 | 4'200 CHF | 101.40% | 4'258'800.00 | 0.18 | a) |
| CH1253456086 | 2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29 | 0 | 3'650 | 0 | 3'650 CHF | 103.05% | 3'761'325.00 | 0.16 | a) |
| CH1255924396 | 2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30 | 0 | 2'530 | 0 | 2'530 CHF | 102.30% | 2'588'190.00 | 0.11 | a) |
| CH1255924404 | 2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27 | 0 | 5'380 | 0 | 5'380 CHF | 102.20% | 5'498'360.00 | 0.23 | a) |
| CH1255924412 | 3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31 | 0 | 5'110 | 0 | 5'110 CHF | 106.35% | 5'434'485.00 | 0.23 | a) |
| CH1255924453 | 2.3500 % GALESW 2.35 11/08/29 | 0 | 7'875 | 2'700 | 5'175 CHF | 103.60% | 5'361'300.00 | 0.23 | a) |
| CH1255924479 | 2.1000 % LONNVX 2.1 09/12/29 APR | 0 | 2'160 | 2'160 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1256367199 | 2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33 | 0 | 2'660 | 2'660 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1256367207 | 2.5075 % ACAFP 2.5075 04/27/27 EMTN | 0 | 6'000 | 0 | 6'000 CHF | 102.50% | 6'150'000.00 | 0.26 | a) |
| CH1261608900 | 2.8325 % DZBK 2.8325 05/16/29 EMTN | 0 | 2'000 | 0 | 2'000 CHF | 103.05% | 2'061'000.00 | 0.09 | a) |
| CH1261608934 | 2.7475 % HYUCAP 2.7475 05/11/26 GMTN | 0 | 3'600 | 0 | 3'600 CHF | 102.20% | 3'679'200.00 | 0.15 | a) |
| CH1264414322 | 3.8000 % CMZB 3.8 05/03/28 EMTN | 0 | 2'500 | 0 | 2'500 CHF | 104.25% | 2'606'250.00 | 0.11 | a) |
| CH1264414330 | 3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN | 0 | 4'200 | 4'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1264414348 | 2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN | 0 | 9'600 | 0 | 9'600 CHF | 101.70% | 9'763'200.00 | 0.41 | a) |
| CH1264823472 | 2.7825 % SUDAM 2.7825 05/23/25 EMTN | 0 | 1'800 | 0 | 1'800 CHF | 100.89% | 1'816'020.00 | 0.08 | a) |
| CH1264823480 | 2.3850 % UBS 2.385 05/09/25 EMTN | 0 | 5'600 | 0 | 5'600 CHF | 100.81% | 5'645'360.00 | 0.24 | a) |
| CH1264823498 | 2.5500 % UBS 2.55 05/09/29 EMTN | 0 | 3'500 | 0 | 3'500 CHF | 104.15% | 3'645'250.00 | 0.15 | a) |
| CH1264823514 | 2.4900 % NDAFH 2.49 05/26/28 EMTN | 0 | 6'000 | 0 | 6'000 CHF | 102.35% | 6'141'000.00 | 0.26 | a) |
| CH1264887386 | 2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28 | 0 | 2'480 | 0 | 2'480 CHF | 102.45% | 2'540'760.00 | 0.11 | a) |
| CH1264887428 | 3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31 JULY | 0 | 1'300 | 1'300 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1264887444 | 2.9025 % CAABNK 2.9025 07/20/26 | 0 | 3'200 | 0 | 3'200 CHF | 101.50% | 3'248'000.00 | 0.14 | a) |
| CH1266846992 | 2.6250 % AMALEA 2 5/8 05/26/26 | 0 | 3'250 | 0 | 3'250 CHF | 101.25% | 3'290'625.00 | 0.14 | a) |
| CH1266847073 | 2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38 | 0 | 3'440 | 0 | 3'440 CHF | 108.75% | 3'741'000.00 | 0.16 | a) |
| CH1266847131 | 2.6650 % CMBNSW 2.665 06/28/30 | 0 | 4'705 | 0 | 4'705 CHF | 104.20% | 4'902'610.00 | 0.21 | a) |
| CH1266847156 | 1.9000 % SWISSG 1.9 06/30/26 | 0 | 4'575 | 0 | 4'575 CHF | 100.85% | 4'613'887.50 | 0.19 | a) |
| CH1266847172 | 2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38 | 0 | 1'675 | 0 | 1'675 CHF | 108.75% | 1'821'562.50 | 0.08 | a) |
| CH1267329279 | 2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32 | 0 | 3'685 | 3'685 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1268922205 | 2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26 | 0 | 3'600 | 3'600 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1268922213 | 3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29 | 0 | 2'700 | 2'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1270825503 | 2.3825 % BPCEGP 2.3825 06/12/26 EMTN | 0 | 4'800 | 0 | 4'800 CHF | 101.65% | 4'879'200.00 | 0.21 | a) |
| CH1270825511 | 2.6550 % BPCEGP 2.655 06/12/30 EMTN | 0 | 4'950 | 0 | 4'950 CHF | 104.10% | 5'152'950.00 | 0.22 | a) |
| CH1270825529 | 4.2525 % MUNHYP 4.2525 06/07/33 EMTN | 0 | 3'100 | 0 | 3'100 CHF | 104.45% | 3'237'950.00 | 0.14 | a) |
| CH1270825545 | 2.8575 % NWG 2.8575 06/06/28 EMTN | 0 | 5'000 | 0 | 5'000 CHF | 103.75% | 5'187'500.00 | 0.22 | a) |
| CH1271007945 | 2.1125 % RAIFFS 2.1125 09/28/28 | 0 | 2'700 | 0 | 2'700 CHF | 101.85% | 2'749'950.00 | 0.12 | a) |
| CH1271007952 | 2.3750 % HYNOC 2 3/8 01/26/29 EMTN | 0 | 2'300 | 0 | 2'300 CHF | 101.15% | 2'326'450.00 | 0.10 | a) |
| CH1271360401 | 2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN | 0 | 3'800 | 0 | 3'800 CHF | 102.65% | 3'900'700.00 | 0.16 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|---|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| CH1271360625 | 2.8750 % EQIX 2 7/8 09/12/28 | 0 | 2'620 | 2'620 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1271360633 | 2.1725 % KORWAT 2.1725 09/18/25 EMTN | 0 | 1'990 | 0 | 1'990 CHF | 100.75% | 2'004'925.00 | 0.08 | a) |
| CH1271360641 | 2.0275 % KORAIL 2.0275 11/14/25 EMTN | 0 | 4'900 | 0 | 4'900 CHF | 100.65% | 4'931'850.00 | 0.21 | a) |
| CH1273429691 | 2.6850 % DNBNO 2.685 06/15/28 EMTN | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 101.50% | 2'842'000.00 | 0.12 | a) |
| CH1273475397 | 1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29 | 0 | 6'260 | 0 | 6'260 CHF | 102.60% | 6'422'760.00 | 0.27 | a) |
| CH1273475405 | 2.0000 % NESNVX 2 06/28/33 | 0 | 9'600 | 0 | 9'600 CHF | 104.65% | 10'046'400.00 | 0.42 | a) |
| CH1273475413 | 2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38 | 0 | 8'910 | 0 | 8'910 CHF | 107.35% | 9'564'885.00 | 0.40 | a) |
| CH1273475421 | 2.3000 % ABNANV 2.3 06/26/25 EMTN | 0 | 4'200 | 0 | 4'200 CHF | 100.86% | 4'236'120.00 | 0.18 | a) |
| CH1274703151 | 2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN | 0 | 2'040 | 0 | 2'040 CHF | 102.05% | 2'081'820.00 | 0.09 | a) |
| CH1276269722 | 2.5050 % ABNANV 2.505 06/26/28 | 0 | 5'000 | 0 | 5'000 CHF | 102.65% | 5'132'500.00 | 0.22 | a) |
| CH1276269730 | 2.7300 % BFCM 2.73 07/11/30 EMTN | 0 | 5'270 | 0 | 5'270 CHF | 105.15% | 5'541'405.00 | 0.23 | a) |
| CH1276269748 | 3.0000 % CRNBK 3 07/14/25 | 0 | 2'365 | 0 | 2'365 CHF | 101.27% | 2'395'035.50 | 0.10 | a) |
| CH1276269755 | 2.7325 % SANSCF 2.7325 07/04/25 EMTN | 0 | 5'500 | 0 | 5'500 CHF | 101.32% | 5'572'600.00 | 0.23 | a) |
| CH1276269763 | 2.9325 % SANSCF 2.9325 07/04/28 EMTN | 0 | 2'700 | 0 | 2'700 CHF | 104.10% | 2'810'700.00 | 0.12 | a) |
| CH1276313272 | 3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25 | 0 | 3'500 | 0 | 3'500 CHF | 101.20% | 3'542'000.00 | 0.15 | a) |
| CH1276313280 | 3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28 | 0 | 3'250 | 0 | 3'250 CHF | 104.00% | 3'380'000.00 | 0.14 | a) |
| CH1276313330 | 2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31 | 0 | 4'390 | 4'390 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1277080508 | 1.8850 % DBHNGR 1.885 09/13/35 EMTN | 0 | 6'600 | 0 | 6'600 CHF | 104.70% | 6'910'200.00 | 0.29 | a) |
| CH1277582008 | 2.3400 % ENGIFP 2.34 01/04/27 EMTN | 0 | 3'400 | 0 | 3'400 CHF | 102.00% | 3'468'000.00 | 0.15 | a) |
| CH1277582016 | 2.4900 % ENGIFP 2.49 07/04/31 EMTN | 0 | 4'600 | 0 | 4'600 CHF | 104.45% | 4'804'700.00 | 0.20 | a) |
| CH1280994299 | 2.9700 % NWISE 2.97 09/08/27 EMTN | 0 | 4'400 | 0 | 4'400 CHF | 102.35% | 4'503'400.00 | 0.19 | a) |
| CH1280994307 | 2.7300 % AMALEA 2.73 09/04/26 | 0 | 3'700 | 0 | 3'700 CHF | 101.55% | 3'757'350.00 | 0.16 | a) |
| CH1280994315 | 3.0125 % AMALEA 3.0125 09/04/29 | 0 | 3'700 | 0 | 3'700 CHF | 102.95% | 3'809'150.00 | 0.16 | a) |
| CH1289657111 | 2.0000 % EMMI 2 09/22/28 | 0 | 4'400 | 0 | 4'400 CHF | 102.10% | 4'492'400.00 | 0.19 | a) |
| CH1289657137 | 2.2010 % NAB 2.201 04/12/29 GMTN | 0 | 5'800 | 0 | 5'800 CHF | 102.80% | 5'962'400.00 | 0.25 | a) |
| CH1290222285 | 2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27 | 0 | 3'050 | 0 | 3'050 CHF | 101.70% | 3'101'850.00 | 0.13 | a) |
| CH1290222293 | 2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30 | 0 | 4'250 | 0 | 4'250 CHF | 103.25% | 4'388'125.00 | 0.18 | a) |
| CH1290222301 | 2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33 | 0 | 3'980 | 0 | 3'980 CHF | 106.70% | 4'246'660.00 | 0.18 | a) |
| CH1290222319 | 2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38 | 0 | 4'030 | 0 | 4'030 CHF | 108.95% | 4'390'685.00 | 0.18 | a) |
| CH1290222335 | 2.2675 % SPSNSW 2.2675 09/18/28 | 0 | 3'900 | 0 | 3'900 CHF | 102.10% | 3'981'900.00 | 0.17 | a) |
| CH1290222400 | 2.5385 % CMBNSW 2.5385 04/05/29 | 0 | 3'200 | 0 | 3'200 CHF | 103.05% | 3'297'600.00 | 0.14 | a) |
| CH1290222426 | 2.8500 % TEMNSW 2.85 10/11/28 | 0 | 5'140 | 0 | 5'140 CHF | 89.20% | 4'584'880.00 | 0.19 | a) |
| CH1290222467 | 2.2500 % VISECA 2 1/4 10/27/26 | 0 | 5'600 | 0 | 5'600 CHF | 101.70% | 5'695'200.00 | 0.24 | a) |
| CH1290222491 | 2.6250 % ZKB 2 5/8 11/01/30 | 0 | 3'700 | 0 | 3'700 CHF | 103.65% | 3'835'050.00 | 0.16 | a) |
| CH1290222558 | 2.0000 % SGSNVX 2 11/17/27 | 0 | 5'000 | 0 | 5'000 CHF | 101.55% | 5'077'500.00 | 0.21 | a) |
| CH1290222566 | 2.3000 % SGSNVX 2.3 11/17/31 | 0 | 5'700 | 0 | 5'700 CHF | 104.50% | 5'956'500.00 | 0.25 | a) |
| CH1290870869 | 2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28 | 0 | 4'330 | 0 | 4'330 CHF | 102.75% | 4'449'075.00 | 0.19 | a) |
| CH1290870877 | 2.5000 % MIGBAN 2 1/2 09/26/33 | 0 | 2'920 | 0 | 2'920 CHF | 105.90% | 3'092'280.00 | 0.13 | a) |
| CH1290870901 | 2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28 | 0 | 3'050 | 0 | 3'050 CHF | 102.25% | 3'118'625.00 | 0.13 | a) |
| CH1290870950 | 2.1250 % SDZSW 2 1/8 11/17/26 | 0 | 8'360 | 0 | 8'360 CHF | 101.30% | 8'468'680.00 | 0.36 | a) |
| CH1290870968 | 2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31 | 0 | 7'360 | 0 | 7'360 CHF | 104.75% | 7'709'600.00 | 0.32 | a) |
| CH1290870976 | 2.1225 % BNP 2.1225 01/12/32 EMTN | 0 | 4'200 | 0 | 4'200 CHF | 101.75% | 4'273'500.00 | 0.18 | a) |
| CH1290871008 | 2.3950 % SANTAN 2.395 02/16/29 EMTN | 0 | 8'400 | 0 | 8'400 CHF | 101.52% | 8'527'344.00 | 0.36 | a) |
| CH1290871016 | 2.2400 % SANTAN 2.24 02/16/32 EMTN | 0 | 7'000 | 0 | 7'000 CHF | 102.02% | 7'141'610.00 | 0.30 | a) |
| CH1291809908 | 2.3000 % EDF 2.3 09/14/27 EMTN | 0 | 3'900 | 0 | 3'900 CHF | 102.50% | 3'997'500.00 | 0.17 | a) |
| CH1291809916 | 2.5500 % EDF 2.55 09/12/31 EMTN | 0 | 2'450 | 0 | 2'450 CHF | 104.85% | 2'568'825.00 | 0.11 | a) |
| CH1293237975 | 1.9650 % ABBNVX 1.965 09/22/26 | 0 | 6'500 | 0 | 6'500 CHF | 101.15% | 6'574'750.00 | 0.28 | a) |
| CH1293237983 | 1.9775 % ABBNVX 1.9775 09/22/28 | 0 | 3'000 | 0 | 3'000 CHF | 102.15% | 3'064'500.00 | 0.13 | a) |
| CH1293237991 | 2.1125 % ABBNVX 2.1125 09/22/33 | 0 | 6'500 | 0 | 6'500 CHF | 104.45% | 6'789'250.00 | 0.29 | a) |
| CH1293238007 | 2.2025 % DZBK 2.2025 09/18/28 EMTN | 0 | 2'200 | 0 | 2'200 CHF | 101.45% | 2'231'900.00 | 0.09 | a) |
| CH1293238015 | 2.5000 % AXPOSW 2 1/2 09/22/26 | 0 | 6'000 | 0 | 6'000 CHF | 101.80% | 6'108'000.00 | 0.26 | a) |
| CH1293714338 | 2.7175 % ANDINA 2.7175 09/20/28 | 0 | 3'500 | 3'500 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1293714346 | 2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28 | 0 | 4'250 | 0 | 4'250 CHF | 102.60% | 4'360'500.00 | 0.18 | a) |
| CH1293714353 | 2.4000 % PGHNSW 2.4 09/26/33 | 0 | 4'900 | 0 | 4'900 CHF | 104.85% | 5'137'650.00 | 0.22 | a) |
| CH1293714361 | 2.3750 % INSBER 2 3/8 09/29/31 | 0 | 3'200 | 0 | 3'200 CHF | 105.50% | 3'376'000.00 | 0.14 | a) |
| CH1293714379 | 2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38 | 0 | 3'250 | 0 | 3'250 CHF | 109.55% | 3'560'375.00 | 0.15 | a) |
| CH1294486324 | 2.3825 % BNS 2.3825 09/22/27 EMTN | 0 | 4'700 | 0 | 4'700 CHF | 102.25% | 4'805'750.00 | 0.20 | a) |
| CH1294486357 | 2.3625 % ACAFP 2.3625 10/05/28 EMTN | 0 | 3'100 | 0 | 3'100 CHF | 102.55% | 3'179'050.00 | 0.13 | a) |
| CH1294486365 | 3.6100 % DZBK 3.61 10/16/28 EMTN | 0 | 2'100 | 0 | 2'100 CHF | 101.85% | 2'138'850.00 | 0.09 | a) |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-------------------------|--------------|------|
| CH1296276152 | 2.4700 % ACHMEA 2.47 10/16/26 EMTN | 0 | 1'800 | 0 | 1'800 CHF | 101.60% | 1'828'800.00 | 0.08 | a) |
| CH1296276160 | 2.7475 % ACHMEA 2.7475 10/16/30 EMTN | 0 | 2'200 | 0 | 2'200 CHF | 102.85% | 2'262'700.00 | 0.10 | a) |
| CH1298665980 | 2.9600 % FREGR 2.96 10/18/28 EMTN | 0 | 5'600 | 0 | 5'600 CHF | 104.25% | 5'838'000.00 | 0.25 | a) |
| CH1298957064 | 2.6825 % SOCGEN 2.6825 10/19/29 EMTN | 0 | 5'000 | 0 | 5'000 CHF | 103.85% | 5'192'500.00 | 0.22 | a) |
| CH1300224875 | 1.9600 % MBGGR 1.96 10/12/26 EMTN | 0 | 4'400 | 0 | 4'400 CHF | 101.10% | 4'448'400.00 | 0.19 | a) |
| CH1300224883 | 2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN | 0 | 4'250 | 0 | 4'250 CHF | 103.10% | 4'381'750.00 | 0.18 | a) |
| CH1300277733 | 2.2500 % BHH 2 1/4 11/08/27 EMTN | 0 | 1'900 | 0 | 1'900 CHF | 101.70% | 1'932'300.00 | 0.08 | a) |
| CH1300277816 | 1.7425 % HILTI 1.7425 11/10/26 | 0 | 1'600 | 0 | 1'600 CHF | 100.80% | 1'612'800.00 | 0.07 | a) |
| CH1300277824 | 1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31 | 0 | 2'605 | 0 | 2'605 CHF | 104.15% | 2'713'107.50 | 0.11 | a) |
| CH1300277832 | 1.6250 % NESNVX 1 5/8 11/20/27 | 0 | 3'500 | 0 | 3'500 CHF | 101.10% | 3'538'500.00 | 0.15 | a) |
| CH1300277840 | 1.8750 % NESNVX 1 7/8 11/20/31 | 0 | 4'500 | 0 | 4'500 CHF | 103.30% | 4'648'500.00 | 0.20 | a) |
| CH1300277857 | 2.0000 % NESNVX 2 11/20/36 | 0 | 4'100 | 0 | 4'100 CHF | 105.35% | 4'319'350.00 | 0.18 | a) |
| CH1300277865 | 2.3000 % BELLSW 2.3 10/15/26 | 0 | 2'650 | 0 | 2'650 CHF | 101.60% | 2'692'400.00 | 0.11 | a) |
| CH1300277873 | 2.6500 % BELLSW 2.65 10/15/31 | 0 | 3'615 | 0 | 3'615 CHF | 105.15% | 3'801'172.50 | 0.16 | a) |
| CH1300277881 | 2.2500 % LONNVX 2 1/4 05/16/28 | 0 | 3'300 | 0 | 3'300 CHF | 101.90% | 3'362'700.00 | 0.14 | a) |
| CH1300277899 | 2.6000 % LONNVX 2.6 05/16/31 | 0 | 4'800 | 0 | 4'800 CHF | 104.20% | 5'001'600.00 | 0.21 | a) |
| CH1300950008 | 2.0100 % TOYOTA 2.01 10/26/26 EMTN | 0 | 5'800 | 0 | 5'800 CHF | 101.10% | 5'863'800.00 | 0.25 | a) |
| CH1300950016 | 2.1200 % TOYOTA 2.12 10/26/29 EMTN | 0 | 3'400 | 0 | 3'400 CHF | 102.90% | 3'498'600.00 | 0.15 | a) |
| CH1300950032 | 2.4450 % BSANCI 2.445 01/25/27 EMTN | 0 | 5'500 | 0 | 5'500 CHF | 100.55% | 5'530'250.00 | 0.23 | a) |
| CH1305916731 | 2.3750 % GIVNVX 2 3/8 05/23/31 | 0 | 5'370 | 0 | 5'370 CHF | 105.00% | 5'638'500.00 | 0.24 | a) |
| CH1305916764 | 1.6000 % ROSW 1.6 09/15/28 | 0 | 4'200 | 4'200 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1305916772 | 1.7500 % ROSW 1 3/4 09/15/33 | 0 | 4'900 | 4'900 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1305916780 | 1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38 | 0 | 4'700 | 4'700 | 0 CHF | 0.00% | 0.00 | 0.00 | |
| CH1305916830 | 1.8000 % PSPNSW 1.8 12/11/26 | 0 | 3'050 | 0 | 3'050 CHF | 100.35% | 3'060'675.00 | 0.13 | a) |
| CH1305916905 | 1.8425 % ACAFP 1.8425 01/17/30 EMTN | 0 | 4'800 | 0 | 4'800 CHF | 100.25% | 4'812'000.00 | 0.20 | a) |
| CH1306117040 | 2.5000 % LLBSW 2 1/2 11/22/30 | 0 | 4'000 | 0 | 4'000 CHF | 102.05% | 4'082'000.00 | 0.17 | a) |
| CH1306117131 | 1.7000 % PSPNSW 1.7 02/06/30 | 0 | 3'000 | 0 | 3'000 CHF | 100.00% | 3'000'000.00 | 0.13 | a) |
| CH1307121264 | 2.2500 % KWLILJ 2 1/4 12/05/25 | 0 | 2'000 | 0 | 2'000 CHF | 101.05% | 2'021'000.00 | 0.08 | a) |
| CH1307121272 | 2.3750 % KWLILJ 2 3/8 12/05/29 | 0 | 1'780 | 0 | 1'780 CHF | 103.25% | 1'837'850.00 | 0.08 | a) |
| CH1314941423 | 1.9500 % BARY 1.95 01/24/28 | 0 | 3'900 | 0 | 3'900 CHF | 101.35% | 3'952'650.00 | 0.17 | a) |
| CH1314941431 | 2.3000 % BARY 2.3 01/23/32 | 0 | 6'300 | 0 | 6'300 CHF | 102.70% | 6'470'100.00 | 0.27 | a) |
| CH1314941449 | 2.5000 % AMALEA 2 1/2 02/12/27 | 0 | 1'500 | 0 | 1'500 CHF | 101.20% | 1'518'000.00 | 0.06 | a) |
| CH1314941456 | 2.7500 % AMALEA 2 3/4 02/12/29 | 0 | 3'500 | 0 | 3'500 CHF | 101.65% | 3'557'750.00 | 0.15 | a) |
| CH1314941472 | 2.2150 % CMBNSW 2.215 02/05/30 | 0 | 5'535 | 0 | 5'535 CHF | 101.55% | 5'620'792.50 | 0.24 | a) |
| CH1319968496 | 1.8000 % SPSNSW 1.8 03/01/30 | 0 | 4'900 | 0 | 4'900 CHF | 99.80% | 4'890'200.00 | 0.21 | a) |
| CH1321113453 | 2.2225 % BFCM 2.2225 01/30/32 EMTN | 0 | 6'200 | 0 | 6'200 CHF | 102.25% | 6'339'500.00 | 0.27 | a) |
| CH1321481538 | 2.5000 % MUNHYP 2 1/2 02/20/30 EMTN | 0 | 3'200 | 0 | 3'200 CHF | 101.05% | 3'233'600.00 | 0.14 | a) |
| CH1321481546 | 2.5650 % ANNGR 2.565 02/14/29 EMTN | 0 | 2'800 | 0 | 2'800 CHF | 101.00% | 2'828'000.00 | 0.12 | a) |
| CH1321737780 | 2.2450 % DB 2.245 01/25/30 EMTN | 0 | 4'000 | 0 | 4'000 CHF | 101.25% | 4'050'000.00 | 0.17 | a) |
| CH1322499612 | 2.2075 % VW 2.2075 02/12/27 EMTN | 0 | 4'780 | 0 | 4'780 CHF | 100.98% | 4'826'987.40 | 0.20 | a) |
| CH1322499620 | 2.4925 % VW 2.4925 02/12/30 EMTN | 0 | 5'510 | 0 | 5'510 CHF | 102.60% | 5'653'094.70 | 0.24 | a) |
| CH1325807845 | 2.0125 % ADCBUH 2.0125 02/22/30 | 0 | 2'500 | 0 | 2'500 CHF | 100.15% | 2'503'750.00 | 0.11 | a) |
| CH1325807886 | 2.1750 % CABKSM 2.175 03/19/30 EMTN | 0 | 5'400 | 0 | 5'400 CHF | 100.61% | 5'433'156.00 | 0.23 | a) |
| CH1325807902 | 2.0500 % ACAFP 2.05 03/07/34 EMTN | 0 | 5'400 | 0 | 5'400 CHF | 100.44% | 5'423'544.00 | 0.23 | a) |
| CH1331113477 | 1.6525 % TMO 1.6525 03/07/28 | 0 | 4'900 | 0 | 4'900 CHF | 100.45% | 4'922'098.51 | 0.21 | a) |
| CH1331113485 | 1.8401 % TMO 1.8401 03/08/32 | 0 | 6'400 | 0 | 6'400 CHF | 100.77% | 6'449'536.00 | 0.27 | a) |
| CH1331113493 | 2.0375 % TMO 2.0375 03/07/36 | 0 | 4'900 | 0 | 4'900 CHF | 101.28% | 4'962'818.00 | 0.21 | a) |
| CHF | | | | | | | 2'356'802'928.11 | 99.03 | |

Vermögensaufstellung

| | Kurswert CHF | in % 7) |
|---|-------------------------|---------------|
| Bankguthaben auf Sicht | 4'979'011.89 | 0.21 |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 2'356'802'928.11 | 99.03 |
| Sonstige Vermögenswerte | 18'017'057.57 | 0.76 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 2'379'798'997.57 | 100.00 |
| Andere Verbindlichkeiten | -9'259.03 | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 2'379'789'738.54 | |

| Bewertungskategorien | | Kurswert CHF | in % 7) |
|----------------------|---|------------------|------------|
| a) | Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG); | 2'356'802'928.11 | 99.03 |
| b) | Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern; | 0.00 | 0.00 |
| c) | Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden. | 0.00 | 0.00 |

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

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 | |
| FA CHF | CHF | 0.00 - 0.49 | - | 0.199 | 0.00 - 0.05 | - | 0.001 |
| GA CHF | CHF | 0.00 - 0.49 | - | 0.199 | 0.00 - 0.05 | - | 0.001 |
| GT CHF | CHF | 0.00 - 0.49 | - | 0.199 | 0.00 - 0.05 | - | 0.001 |
| NT CHF | CHF | 0.00 - 0.49 | - | 0.199 | 0.00 - 0.05 | - | 0.001 |

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

| Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten | Währung | Betrag |
|--|---------|--------|
| Keine | CHF | - |

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

| Klasse | PVK p.a. in % | | PMF p.a. in % | PAF p.a. in % | VK Zielfonds p.a. in % |
|--------|---------------|-------|---------------|---------------|------------------------|
| | Eff | Max | Eff | Eff | Max |
| FA CHF | 0.160 | 0.500 | 0.110 | 0.050 | 3.000 |
| GA CHF | 0.120 | 0.350 | 0.070 | 0.050 | 3.000 |
| GT CHF | 0.120 | 0.350 | 0.070 | 0.050 | 3.000 |
| NT CHF | - | - | - | - | 3.000 |

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

8 Benchmark

SBI® Corporate TR

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| FA CHF | Nein | CHF | 0.95000 | 0.33250 | 0.61750 |
| GA CHF | Nein | CHF | 1.00000 | 0.35000 | 0.65000 |

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|--------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| GT CHF | Nein | CHF | 0.96515 | 0.33780 | 0.62735 |
| NT CHF | Nein | CHF | 1.079 | 0.377 | 0.702 |

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

mit den Teilvermögen

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

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

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Begründung für die Vereinigung

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigung

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

II Änderungen im Fondsvertrag

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

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

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

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

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

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

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

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

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

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

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

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

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

* * *

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

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

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

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

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

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

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

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

2.2 Umtauschverhältnisse

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

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

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

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

Zürich, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

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

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

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

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

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

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

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

betreffend

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

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

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

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

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

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

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

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

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

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

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

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

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

2 Gating-Verfahren

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 23. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

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

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

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

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich