

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND TOTAL MARKET AAA-BBB 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»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA CHF	114034068	CHF
GT CHF	114034069	CHF
NT CHF	114034070	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://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) Responsible<sup>1</sup>
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible<sup>1</sup>
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible<sup>1</sup>
- ▶ 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 Jahr<sup>1</sup>, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

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

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



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

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



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

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

---

<sup>1</sup> 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	30
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	30
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	31
7	Pauschale Verwaltungskommission	31
8	Benchmark	31
9	TER	31
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	32
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	32
12	Fussnoten	32
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	33
14	Pflichtpublikationen	35

# 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	04.11.2021
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022
<b>Konsolidiert</b>				
	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'813'525'260.29	1'627'502'081.77	1'305'104'925.17
<b>Klasse FA CHF</b>				
	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'889'410.84	8'632'873.28	3'334'651.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		148'433.477	97'090.678	34'443.647
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.5733	88.9156	96.8147
Ausschüttung je Anteil		0.75	0.65	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse GT CHF</b>				
	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		583'988'440.93	350'184'239.78	267'262'270.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'203'828.246	3'936'444.429	2'759'933.150
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		94.1336	88.9595	96.8365
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		98.7881	89.5005	93.9719
Thesaurierung je Anteil		0.81	0.63	0.14
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.11 %	0.11 %	0.11 %
<b>Klasse NT CHF</b>				
	<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'215'647'408.52	1'268'684'968.71	1'034'508'003.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'489'615.793	14'242'680.935	10'679'303.775
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		94.3245	89.0763	96.8704
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		98.9886	89.6180	94.0047
Thesaurierung je Anteil		0.91	0.73	0.18
Total Expense Ratio (Synthetische 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 04.11.2021)	6.00 %	7.13 %	-11.82 %	0.04 %
Klasse GT CHF (Lancierung 04.11.2021)	6.08 %	7.20 %	-11.75 %	0.06 %
Klasse NT CHF (Lancierung 04.11.2021)	6.19 %	7.32 %	-11.65 %	0.07 %
Benchmark	6.18 %	7.36 %	-12.10 %	-0.16 %
Tracking Error 33)	0.06 %	0.11 %	0.27 %	0.23 %

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 04.11.2021)	-0.18 %
Klasse GT CHF (Lancierung 04.11.2021)	-0.10 %
Klasse NT CHF (Lancierung 04.11.2021)	0.01 %

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	10'817'811.92	10'322'443.08
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'021'425'639.80	1'155'315'146.89
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	765'837'424.74	453'499'429.73
Sonstige Vermögenswerte	15'494'311.65	8'395'433.00
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'813'575'188.11</b>	<b>1'627'532'452.70</b>
Andere Verbindlichkeiten	-49'927.82	-30'370.93
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'813'525'260.29</b>	<b>1'627'502'081.77</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		97'090.678	34'443.647
Ausgegebene Anteile		58'986.767	98'366.085
Zurückgenommene Anteile		-7'643.968	-35'719.054
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>148'433.477</b>	<b>97'090.678</b>

Klasse GT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'936'444.429	2'759'933.150
Ausgegebene Anteile		3'166'774.313	1'729'044.500
Zurückgenommene Anteile		-899'390.496	-552'533.221
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>6'203'828.246</b>	<b>3'936'444.429</b>

Klasse NT CHF	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'242'680.935	10'679'303.775
Ausgegebene Anteile		6'690'916.951	3'926'322.028
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		3'584'144.448	1'487'145.022
Zurückgenommene Anteile		-1'028'126.541	-1'850'089.890
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>23'489'615.793</b>	<b>14'242'680.935</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	14.03.2023	14'117'703.86	156'576.667
Klasse NT CHF	14.03.2023	9'289'561.23	103'028.690
Klasse NT CHF	30.05.2023	68'491'671.88	752'774.028
Klasse NT CHF	10.11.2023	20'424'399.17	222'071.443
Klasse NT CHF	22.11.2023	20'938'881.42	225'630.851
Klasse NT CHF	24.11.2023	84'016'942.73	908'905.398
Klasse NT CHF	24.11.2023	70'138'749.19	758'769.430
Klasse NT CHF	06.12.2023	10'007'636.07	106'052.639
Klasse NT CHF	22.01.2024	6'090'916.56	64'995.012
Klasse NT CHF	19.02.2024	26'749'938.84	285'340.290

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'627'502'081.77	1'305'104'925.17
Ausbezahlte Ausschüttung		-72'645.70	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'916'474.81	-893'739.17
Saldo aus dem Anteilverkehr		1'055'599'759.32	434'938'528.38
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		136'412'539.71	-111'647'632.61
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'813'525'260.29</b>	<b>1'627'502'081.77</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		53'281.56	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-35'413.31
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		17'510'283.32	9'850'214.21
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		4'634'388.75	1'723'431.39
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		6'084'020.88	2'920'478.63
<b>Total Ertrag</b>		<b>28'281'974.51</b>	<b>14'458'710.92</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-563'302.70	-336'863.19
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'026'767.59	-1'051'401.01
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'590'070.29</b>	<b>-1'388'264.20</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>26'691'904.22</b>	<b>13'070'446.72</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-7'518'137.81	-3'689'857.81
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		3'251'910.21	1'406'819.40
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>22'425'676.62</b>	<b>10'787'408.31</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		113'986'863.09	-122'435'040.92
<b>Gesamterfolg</b>		<b>136'412'539.71</b>	<b>-111'647'632.61</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse FA CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	113'353.27	63'530.59
Vortrag des Vorjahres	4'769.61	4'347.96
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>118'122.88</b>	<b>67'878.55</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	111'325.11	63'108.94
Vortrag auf neue Rechnung	6'797.77	4'769.61
<b>Total</b>	<b>118'122.88</b>	<b>67'878.55</b>
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	5'051'429.19	2'506'117.87
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>5'051'429.19</b>	<b>2'506'117.87</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'768'000.22	877'141.25
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'283'428.97	1'628'976.62
<b>Total</b>	<b>5'051'429.19</b>	<b>2'506'117.87</b>
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>29.02.2024</b>	<b>28.02.2023</b>
Nettoertrag	21'527'121.76	10'500'798.26
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>21'527'121.76</b>	<b>10'500'798.26</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'534'492.62	3'675'279.39
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	13'992'629.14	6'825'518.87
<b>Total</b>	<b>21'527'121.76</b>	<b>10'500'798.26</b>

## 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.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>2'021'425'639.80</b>	<b>71.85</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>2'021'425'639.80</b>	<b>71.85</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	19'310	10'690	0	30'000 CHF	112.56%	33'768'000.00	1.20	a)
CH0009755197	4.0000 % SWISS 4 01/06/49	9'210	5'870	0	15'080 CHF	171.70%	25'892'360.00	0.92	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	12'650	11'740	0	24'390 CHF	123.29%	30'070'431.00	1.07	a)
CH0020469075	2.8750 % EUROF 2 7/8 02/04/30	1'610	1'450	0	3'060 CHF	108.95%	3'333'870.00	0.12	a)
CH0020498645	2.7500 % ZURCTY 2 3/4 02/14/25	1'890	600	0	2'490 CHF	101.23%	2'520'627.00	0.09	a)
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	4'070	2'200	0	6'270 CHF	109.40%	6'859'380.00	0.24	a)
CH0021894602	2.5000 % BNG 2 1/2 07/21/25 EMTN	2'230	1'700	0	3'930 CHF	101.51%	3'989'343.00	0.14	a)
CH0022268004	2.5000 % KFW 2 1/2 08/25/25 EMTN	3'860	2'950	0	6'810 CHF	101.77%	6'930'537.00	0.25	a)
CH0022566175	2.5000 % BERCTY 2 1/2 09/26/25	810	300	0	1'110 CHF	101.75%	1'129'425.00	0.04	a)
CH0024141100	2.5000 % CFF 2 1/2 02/24/31 EMTN	1'580	0	0	1'580 CHF	106.40%	1'681'120.00	0.06	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	1'920	150	0	2'070 CHF	113.10%	2'341'170.00	0.08	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	200	550	0	750 CHF	102.20%	766'500.00	0.03	a)
CH0024524966	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36	14'880	10'095	0	24'975 CHF	119.47%	29'837'632.50	1.06	a)
CH0025185676	3.0000 % EUROF 3 05/15/26	3'770	2'100	0	5'870 CHF	103.65%	6'084'255.00	0.22	a)
CH0025662831	3.3750 % KA 3 3/8 06/22/26 EMTN	1'160	600	0	1'760 CHF	103.05%	1'813'680.00	0.06	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	1'000	1'350	2'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	2'010	0	0	2'010 CHF	121.50%	2'442'150.00	0.09	a)
CH0026096567	3.1250 % CMZB 3 1/8 07/14/25 EMTN	1'160	250	0	1'410 CHF	101.97%	1'437'777.00	0.05	a)
CH0026213451	3.2500 % OKB 3 1/4 07/25/36	790	0	0	790 CHF	121.10%	956'690.00	0.03	a)
CH0026233491	3.2500 % NEDWBK 3 1/4 08/07/29 EMTN	1'110	1'550	0	2'660 CHF	110.15%	2'929'990.00	0.10	a)
CH0026302304	3.3750 % ABNANV 3 3/8 08/15/31 EMTN	1'400	600	0	2'000 CHF	112.50%	2'250'000.00	0.08	a)
CH0026620846	3.1250 % RABOBK 3 1/8 09/15/26	0	160	160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0026674314	3.1250 % BUNIMM 3 1/8 09/01/31 EMTN	890	0	0	890 CHF	111.15%	989'235.00	0.04	a)
CH0026985520	2.8750 % KOMMUN 2 7/8 10/13/31 EMTN	1'960	1'050	0	3'010 CHF	111.35%	3'351'635.00	0.12	a)
CH0027752200	2.6250 % OKB 2 5/8 11/22/24	1'830	2'700	0	4'530 CHF	100.80%	4'566'240.00	0.16	a)
CH0029008809	2.7500 % KFW 2 3/4 02/16/37	1'080	0	0	1'080 CHF	115.95%	1'252'260.00	0.04	a)
CH0030653916	3.0000 % EUROF 3 05/22/24	2'030	0	2'030	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	1'200	1'000	0	2'200 CHF	106.13%	2'334'860.00	0.08	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	1'010	0	1'010	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0031409177	3.2500 % BNG 3 1/4 06/29/37 EMTN	350	0	0	350 CHF	123.05%	430'675.00	0.02	a)
CH0031835561	3.2500 % SWISS 3 1/4 06/27/27	10'110	6'560	0	16'670 CHF	107.44%	17'910'248.00	0.64	a)
CH0033596476	3.3750 % EIB 3 3/8 10/15/27	700	500	0	1'200 CHF	107.75%	1'293'000.00	0.05	a)
CH0107134683	2.6250 % EIB 2 5/8 02/11/25	1'190	0	0	1'190 CHF	101.15%	1'203'685.00	0.04	a)
CH0109152758	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/25	400	500	0	900 CHF	101.14%	910'260.00	0.03	a)
CH0109155827	2.6250 % AGFRNC 2 5/8 02/18/25 EMTN	810	0	0	810 CHF	100.95%	817'695.00	0.03	a)
CH0109497690	2.7500 % WINCTY 2 3/4 01/28/30	100	0	0	100 CHF	107.90%	107'900.00	0.00	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	0	295	295	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0111008048	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 03/27/30 512	1'050	620	0	1'670 CHF	107.38%	1'793'246.00	0.06	a)
CH0112933483	2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23	1'280	0	1'280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0114695403	1.7500 % BERN 1 3/4 09/24/25	1'560	750	0	2'310 CHF	100.60%	2'323'860.00	0.08	a)
CH0114695429	2.1250 % GENEVA 2 1/8 10/27/28	850	350	0	1'200 CHF	103.95%	1'247'400.00	0.04	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	3'280	250	0	3'530 CHF	106.56%	3'761'568.00	0.13	a)
CH0116306868	2.0000 % ZKB 2 09/08/25 114	780	2'000	0	2'780 CHF	100.75%	2'800'850.00	0.10	a)
CH0116403517	2.0000 % DNBNO 2 09/02/30 EMTN	630	150	0	780 CHF	102.70%	801'060.00	0.03	a)
CH0117076379	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 09/15/31 524	3'330	1'300	0	4'630 CHF	103.42%	4'788'346.00	0.17	a)
CH0118095667	1.8750 % KBBS 1 7/8 10/26/26	600	0	0	600 CHF	101.40%	608'400.00	0.02	a)
CH0118532735	1.8750 % AGFRNC 1 7/8 11/12/29 EMTN	530	0	0	530 CHF	101.80%	539'540.00	0.02	a)
CH0118668257	2.1250 % BNG 2 1/8 11/09/29 EMTN	1'350	0	0	1'350 CHF	104.30%	1'408'050.00	0.05	a)
CH0118886735	2.0000 % RESFER 2 11/12/26 EMTN	280	550	830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	1'600	1'000	0	2'600 CHF	100.98%	2'625'480.00	0.09	a)
CH0119153663	2.0000 % KBBS 2 11/15/32	300	750	0	1'050 CHF	104.35%	1'095'675.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	470	750	0	1'220 CHF	108.00%	1'317'600.00	0.05	a)
CH0119729793	2.0000 % ZKB 2 11/30/34 115	1'410	950	0	2'360 CHF	104.40%	2'463'840.00	0.09	a)
CH0119858659	2.0000 % ARGOVI 2 12/15/28	800	450	0	1'250 CHF	103.70%	1'296'250.00	0.05	a)
CH0120168486	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 12/01/28 533	2'350	3'180	0	5'530 CHF	103.59%	5'728'527.00	0.20	a)
CH0122787606	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 01/25/24 540	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123423276	2.3750 % ZURCTY 2 3/8 02/21/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0124138840	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 02/16/27 544	1'300	500	0	1'800 CHF	103.35%	1'860'300.00	0.07	a)
CH0124338937	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 548	1'200	4'650	0	5'850 CHF	108.21%	6'330'285.00	0.22	a)
CH0124739902	2.5000 % CADES 2 1/2 12/09/25 EMTN	530	700	0	1'230 CHF	101.95%	1'253'985.00	0.04	a)
CH0124855328	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/10/31 EMTN	600	0	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0125067774	2.6250 % RESFER 2 5/8 03/11/37 EMTN	650	0	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126116539	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/30/26 EMTN	670	750	0	1'420 CHF	102.20%	1'451'240.00	0.05	a)
CH0126183075	2.3750 % ZKB 2 3/8 03/29/23 119	720	0	720	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0126325353	2.3750 % NSWTC 2 3/8 04/26/41 EMTN	0	300	0	300 CHF	117.55%	352'650.00	0.01	a)
CH0126519047	2.5000 % PSHYPO 2 1/2 03/30/26 552	2'330	0	0	2'330 CHF	102.32%	2'384'056.00	0.08	a)
CH0126645396	2.5000 % WINCTY 2 1/2 03/25/38	200	0	0	200 CHF	112.80%	225'600.00	0.01	a)
CH0126875803	2.5000 % BERCTY 2 1/2 04/01/41	580	0	0	580 CHF	117.20%	679'760.00	0.02	a)
CH0126977641	2.2500 % BERN 2 1/4 04/20/26	890	250	0	1'140 CHF	102.05%	1'163'370.00	0.04	a)
CH0127181029	2.2500 % SWISS 2 1/4 06/22/31	11'640	8'250	0	19'890 CHF	110.15%	21'908'835.00	0.78	a)
CH0127181169	1.5000 % SWISS 1 1/2 04/30/42	15'070	8'303	0	23'373 CHF	111.02%	25'948'704.60	0.92	a)
CH0127181177	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/11/24	11'349	500	11'349	500 CHF	99.92%	499'600.00	0.02	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	13'710	8'390	0	22'100 CHF	105.49%	23'313'290.00	0.83	a)
CH0127350376	2.3750 % PFZENT 2 3/8 04/06/26 410	900	2'200	0	3'100 CHF	102.08%	3'164'480.00	0.11	a)
CH0127860192	2.3750 % CADES 2 3/8 04/19/23 EMTN	640	0	640	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0128833255	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/29	400	200	0	600 CHF	106.90%	641'400.00	0.02	a)
CH0128833289	2.6250 % KTBL 2 5/8 05/10/30	100	400	0	500 CHF	108.15%	540'750.00	0.02	a)
CH0128891105	2.7500 % PSHYPO 2 3/4 12/15/26 553	1'300	1'000	0	2'300 CHF	103.84%	2'388'320.00	0.08	a)
CH0129766215	2.6250 % ZURCTY 2 5/8 06/10/38	1'030	0	0	1'030 CHF	116.45%	1'199'435.00	0.04	a)
CH0130158642	2.5000 % ZKB 2 1/2 06/10/31 122	500	250	0	750 CHF	107.05%	802'875.00	0.03	a)
CH0131610740	2.2500 % PFZENT 2 1/4 06/16/23 411	2'000	0	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0132176055	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 06/27/25 554	750	0	0	750 CHF	101.22%	759'150.00	0.03	a)
CH0136611800	1.7500 % EGW 1 3/4 09/14/26 42	300	350	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	4'660	0	0	4'660 CHF	100.99%	4'706'134.00	0.17	a)
CH0138760811	1.6250 % BERCTY 1 5/8 11/01/24	1'060	0	0	1'060 CHF	100.01%	1'060'106.00	0.04	a)
CH0139458720	1.5000 % GENEVA 1 1/2 10/14/24	780	200	980	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0140819845	1.6250 % STGALL 1 5/8 11/10/25	580	400	0	980 CHF	100.35%	983'430.00	0.03	a)
CH0141219698	1.6250 % PFZENT 1 5/8 10/31/24 414	800	500	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0141833407	1.7500 % KBBL 1 3/4 11/22/24	900	0	0	900 CHF	100.03%	900'270.00	0.03	a)
CH0142054391	1.6250 % EIB 1 5/8 11/23/23	890	0	890	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132007	1.6250 % GENEVA 1 5/8 11/28/23	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0142132031	1.5000 % GENEVA 1 1/2 01/27/28	1'170	1'190	0	2'360 CHF	100.85%	2'380'060.00	0.08	a)
CH0142337697	2.0000 % GENEVA 2 11/28/41	670	0	0	670 CHF	108.80%	728'960.00	0.03	a)
CH0142900775	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/28/23	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143302005	1.6250 % BCVAUD 1 5/8 11/30/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0143383971	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 11/29/41 559	750	0	0	750 CHF	102.10%	765'750.00	0.03	a)
CH0143808340	1.2500 % BERN 1 1/4 03/30/27	300	1'100	0	1'400 CHF	100.05%	1'400'700.00	0.05	a)
CH0143838396	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 02/21/24 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0147144361	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 01/21/28 562	2'100	950	0	3'050 CHF	100.66%	3'070'130.00	0.11	a)
CH0148606137	2.3750 % CRH 2 3/8 03/05/24	1'460	0	1'460	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176163	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 02/14/24 564	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0149176171	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 02/14/40 565	2'250	40	0	2'290 CHF	100.25%	2'295'725.00	0.08	a)
CH0149317056	1.5000 % GENEVA 1 1/2 03/05/32	1'910	0	0	1'910 CHF	101.50%	1'938'650.00	0.07	a)
CH0149549575	1.5000 % KBBS 1 1/2 03/02/27	1'130	750	0	1'880 CHF	100.35%	1'886'580.00	0.07	a)
CH0180006113	1.6250 % EIB 1 5/8 04/02/26 EMTN	1'050	1'000	0	2'050 CHF	100.85%	2'067'425.00	0.07	a)
CH0181215028	1.3750 % PFZENT 1 3/8 03/19/27 420	2'400	900	0	3'300 CHF	100.13%	3'304'290.00	0.12	a)
CH0181377042	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 04/12/32	150	1'300	0	1'450 CHF	101.80%	1'476'100.00	0.05	a)
CH0181915734	1.7500 % OKB 1 3/4 05/24/23	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	700	200	0	900 CHF	99.85%	898'650.00	0.03	a)
CH0182337334	1.8750 % WINCTY 1 7/8 04/20/37	670	495	0	1'165 CHF	104.40%	1'216'260.00	0.04	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	400	0	0	400 CHF	100.60%	402'400.00	0.01	a)
CH0182910882	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/17/28 422	2'200	1'200	0	3'400 CHF	101.15%	3'439'100.00	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.
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566	2'440	2'650	0	5'090 CHF	100.54%	5'117'486.00	0.18	a)
CH0184249990	1.5000 % SWISS 1 1/2 07/24/25	12'070	8'490	0	20'560 CHF	100.50%	20'662'800.00	0.73	a)
CH0184636915	1.6000 % KBAARG 1.6 05/18/37	680	0	0	680 CHF	101.30%	688'840.00	0.02	a)
CH0184911961	1.5000 % GENEVA 1 1/2 05/28/27	1'140	1'400	0	2'540 CHF	100.70%	2'557'780.00	0.09	a)
CH0185258222	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/21/29 423	3'700	1'280	0	4'980 CHF	100.81%	5'020'338.00	0.18	a)
CH0185577837	1.4500 % KBFRI 1.45 06/07/27	300	450	0	750 CHF	99.85%	748'875.00	0.03	a)
CH0185712822	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 06/05/37	600	0	0	600 CHF	99.50%	597'000.00	0.02	a)
CH0185754162	1.2500 % EGW 1 1/4 06/15/27 43	670	350	1'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185831366	1.2500 % LAUSAN 1 1/4 06/07/24	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185907083	1.3750 % KUNTA 1 3/8 06/08/27 EMTN	940	450	0	1'390 CHF	100.35%	1'394'865.00	0.05	a)
CH0186162613	1.0000 % ZURCTY 1 12/05/23	830	0	830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188335365	1.7500 % SCMN VX 1 3/4 07/10/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188726852	1.5000 % ABNAV 1 1/2 07/18/23 EMTN	760	0	760	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188927450	1.5000 % EIB 1 1/2 08/02/24	2'030	0	2'030	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0189069732	1.2500 % PFZENT 1 1/4 07/17/24 424	300	300	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190125036	1.3750 % NEDWBK 1 3/8 09/13/27 EMTN	1'050	450	0	1'500 CHF	100.35%	1'505'250.00	0.05	a)
CH0190361029	1.2500 % NEDWBK 1 1/4 08/09/24 EMTN	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0190369378	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 08/02/33 569	2'050	2'150	0	4'200 CHF	100.50%	4'221'000.00	0.15	a)
CH0192241278	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 08/13/27 572	1'000	1'350	0	2'350 CHF	100.14%	2'353'290.00	0.08	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	560	750	0	1'310 CHF	99.70%	1'306'070.00	0.05	a)
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574	2'700	1'990	0	4'690 CHF	100.20%	4'699'380.00	0.17	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	560	450	1'010	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0194695216	1.2500 % GENEVA 1 1/4 10/26/26	500	500	0	1'000 CHF	100.00%	1'000'000.00	0.04	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	780	0	0	780 CHF	99.50%	776'100.00	0.03	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	530	0	0	530 CHF	99.95%	529'735.00	0.02	a)
CH0199543544	1.0000 % ZURICH 1 12/03/25	830	0	0	830 CHF	99.55%	826'265.00	0.03	a)
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	700	0	0	700 CHF	100.15%	701'050.00	0.02	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'450	1'000	0	2'450 CHF	99.60%	2'440'200.00	0.09	a)
CH0200044789	2.3750 % NANTDR 2 3/8 02/15/28	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200044805	1.8750 % KWOBER 1 7/8 02/21/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0200370218	0.8750 % EGW 0 7/8 03/24/23 44	440	0	440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0203872863	1.1250 % ZKB 1 1/8 01/29/24 129	1'140	0	1'140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204017005	1.1250 % AUCCCN 1 1/8 02/07/24 EMTN	690	0	690	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204276213	1.5000 % WINCTY 1 1/2 01/24/36	250	0	0	250 CHF	100.10%	250'250.00	0.01	a)
CH0204365651	1.2500 % BERN 1 1/4 02/07/28	890	0	0	890 CHF	100.10%	890'890.00	0.03	a)
CH0204477290	1.3750 % CRH 1 3/8 03/15/23	560	0	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0204567256	1.3750 % PFZENT 1 3/8 11/05/27 429	3'200	1'850	0	5'050 CHF	100.14%	5'057'070.00	0.18	a)
CH0204975426	1.3750 % EIB 1 3/8 02/21/28	1'190	950	0	2'140 CHF	100.90%	2'159'260.00	0.08	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	500	500	0	1'000 CHF	101.25%	1'012'500.00	0.04	a)
CH0205500017	1.7500 % LUGANO 1 3/4 02/20/43	710	0	0	710 CHF	103.40%	734'140.00	0.03	a)
CH0206728823	1.5000 % BERCTY 1 1/2 02/25/28	600	400	0	1'000 CHF	101.05%	1'010'500.00	0.04	a)
CH0206894740	1.3750 % GRKPSW 1 3/8 03/11/25	0	150	0	150 CHF	99.81%	149'715.00	0.01	a)
CH0206992270	1.5000 % THURBK 1 1/2 03/04/27	970	2'000	0	2'970 CHF	100.25%	2'977'425.00	0.11	a)
CH0207413185	1.8750 % TESSIN 1 7/8 03/18/38	680	500	0	1'180 CHF	105.30%	1'242'540.00	0.04	a)
CH0208200581	1.3750 % EGW 1 3/8 03/27/28 45	300	1'000	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208323441	1.2500 % GENEVA 1 1/4 03/22/23	560	0	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208323458	1.7500 % GENEVA 1 3/4 03/22/33	700	800	0	1'500 CHF	103.65%	1'554'750.00	0.06	a)
CH0208580693	1.1250 % KBFRI 1 1/8 03/28/23	940	0	940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0208897592	1.6500 % ZUGKAN 1.65 04/02/38	630	0	0	630 CHF	101.00%	636'300.00	0.02	a)
CH0209002341	1.5000 % LAUSAN 1 1/2 04/03/28	0	750	0	750 CHF	100.75%	755'625.00	0.03	a)
CH0209654984	1.1250 % LANSBK 1 1/8 04/11/23 EMTN	560	0	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0209782033	1.1250 % GENCTY 1 1/8 04/17/23	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0210240310	1.3750 % PFZENT 1 3/8 04/16/25 432	800	3'550	0	4'350 CHF	99.90%	4'345'650.00	0.15	a)
CH0210461312	1.1250 % KBSH 1 1/8 04/24/23	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588915	1.2500 % PSHYPO 1 1/4 09/29/23 580	2'660	0	2'660	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0211588949	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 07/03/30 581	1'700	2'940	0	4'640 CHF	101.63%	4'715'632.00	0.17	a)
CH0212114653	1.8000 % TESSIN 1.8 05/15/43	390	1'250	0	1'640 CHF	105.25%	1'726'100.00	0.06	a)
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	830	200	0	1'030 CHF	103.80%	1'069'140.00	0.04	a)
CH0212937244	1.7500 % CRH 1 3/4 06/26/25	330	0	0	330 CHF	100.12%	330'396.00	0.01	a)
CH0214010677	1.5200 % LUCERN 1.52 06/12/43	520	0	0	520 CHF	102.30%	531'960.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'020	750	0	1'770 CHF	101.25%	1'792'125.00	0.06	a)
CH0214925882	1.7500 % KTBL 1 3/4 06/26/43	530	0	0	530 CHF	106.50%	564'450.00	0.02	a)
CH0215064350	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/21/28 433	800	2'060	0	2'860 CHF	100.67%	2'879'162.00	0.10	a)
CH0215376325	1.7500 % EIB 1 3/4 06/28/33	830	0	0	830 CHF	104.10%	864'030.00	0.03	a)
CH0216320710	1.2500 % SEK 1 1/4 07/17/23 EMTN	610	0	610	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217579785	1.7500 % EGW 1 3/4 07/24/28 47	810	500	1'310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0217756656	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/15/25 584	2'350	600	0	2'950 CHF	100.46%	2'963'570.00	0.11	a)
CH0217825311	1.7500 % STGALN 1 3/4 07/18/28	970	500	0	1'470 CHF	102.35%	1'504'545.00	0.05	a)
CH0217825337	2.0000 % STGALN 2 07/16/38	560	500	0	1'060 CHF	108.20%	1'146'920.00	0.04	a)
CH0217850681	1.6250 % ZURICH 1 5/8 07/29/26	0	900	0	900 CHF	101.20%	910'800.00	0.03	a)
CH0217850699	2.0000 % ZURICH 2 07/29/38	770	0	0	770 CHF	108.25%	833'525.00	0.03	a)
CH0218517891	1.7500 % PFZENT 1 3/4 02/25/26 436	0	1'100	0	1'100 CHF	100.73%	1'108'030.00	0.04	a)
CH0221999813	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 09/26/24	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0222000413	2.1250 % ZURCTY 2 1/8 09/26/33	500	0	0	500 CHF	107.25%	536'250.00	0.02	a)
CH0222050921	2.0000 % GENEVA 2 03/20/26	760	480	0	1'240 CHF	101.35%	1'256'740.00	0.04	a)
CH0222050939	2.2500 % GENEVA 2 1/4 09/20/29	1'690	500	0	2'190 CHF	105.25%	2'304'975.00	0.08	a)
CH0222261494	1.7500 % THURBK 1 3/4 09/30/24	830	130	960	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0223643260	2.1250 % BERCTY 2 1/8 10/11/38	100	0	0	100 CHF	109.80%	109'800.00	0.00	a)
CH0224396983	1.2500 % SWISS 1 1/4 05/28/26	13'115	7'180	0	20'295 CHF	100.51%	20'398'504.50	0.73	a)
CH0224397007	2.0000 % SWISS 2 06/25/64	11'430	6'780	0	18'210 CHF	148.54%	27'049'134.00	0.96	a)
CH0224397171	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30	12'250	7'070	0	19'320 CHF	98.17%	18'966'444.00	0.67	a)
CH0224397338	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58	7'390	4'200	0	11'590 CHF	93.55%	10'842'445.00	0.39	a)
CH0224397346	0.0000 % SWISS 0 06/22/29	15'428	10'390	0	25'818 CHF	95.64%	24'692'335.20	0.88	a)
CH0224485927	2.0000 % VAUD 2 10/24/33	1'920	500	0	2'420 CHF	107.00%	2'589'400.00	0.09	a)
CH0224581824	2.0000 % LUCERN 2 10/28/33	250	0	0	250 CHF	106.25%	265'625.00	0.01	a)
CH0224761533	1.3750 % ZURICH 1 3/8 12/06/23	890	0	890	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0224923513	1.7500 % KBSH 1 3/4 10/28/25	400	0	0	400 CHF	100.30%	401'200.00	0.01	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	810	0	810	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227678973	1.3750 % LAUSAN 1 3/8 11/27/23	330	0	330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0227976492	1.6250 % GENCTY 1 5/8 12/12/24	2'015	170	0	2'185 CHF	100.09%	2'186'966.50	0.08	a)
CH0228138282	2.0000 % SOLEUR 2 12/02/43	0	300	0	300 CHF	111.15%	333'450.00	0.01	a)
CH0228531460	2.0000 % ZURCTY 2 12/18/43	100	0	0	100 CHF	110.65%	110'650.00	0.00	a)
CH0228622392	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/28/33 587	300	1'900	0	2'200 CHF	106.15%	2'335'300.00	0.08	a)
CH0228674930	2.2500 % GENEVA 2 1/4 12/06/38	750	200	0	950 CHF	111.05%	1'054'975.00	0.04	a)
CH0229881153	2.2500 % WINCTY 2 1/4 02/10/39	470	150	0	620 CHF	110.50%	685'100.00	0.02	a)
CH0233004172	1.6250 % EIB 1 5/8 02/04/25	1'310	1'600	0	2'910 CHF	100.23%	2'916'693.00	0.10	a)
CH0233911988	1.5000 % NAB 1 1/2 02/07/24 EMTN	610	0	610	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0234789193	1.5000 % CFF 1 1/2 02/19/24 EMTN	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0235475354	1.6250 % PFZENT 1 5/8 06/17/26 445	2'720	5'300	0	8'020 CHF	100.62%	8'069'724.00	0.29	a)
CH0235834154	1.5000 % DBHNGR 1 1/2 08/26/24 EMTN	0	645	645	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236122740	1.7500 % SGSNVX 1 3/4 02/27/24	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236516784	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 03/06/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236516834	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 03/06/29	350	0	0	350 CHF	102.55%	358'925.00	0.01	a)
CH0236669591	1.2500 % ZURICH 1 1/4 03/07/24	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0236803992	1.0000 % COE 1 03/06/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0237649964	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 03/03/44 589	940	500	0	1'440 CHF	112.33%	1'617'552.00	0.06	a)
CH0238765116	1.5000 % AUCCCN 1 1/2 11/28/25 EMTN	690	0	0	690 CHF	100.15%	691'035.00	0.02	a)
CH0239713297	1.2500 % BERN 1 1/4 04/22/24	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0239840124	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 11/14/24 591	2'280	1'200	3'480	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0240672235	2.1250 % SYNNVX 2 1/8 11/01/29	0	210	210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	1'230	0	1'230	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0241926317	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/15/25 593	1'830	0	0	1'830 CHF	100.21%	1'833'843.00	0.07	a)
CH0243273759	1.1250 % ACACB 1 1/8 06/05/24 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244692536	2.6250 % OERLSW 2 5/8 06/17/24	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0244975063	1.5000 % WINCTY 1 1/2 06/06/29	400	0	0	400 CHF	100.80%	403'200.00	0.01	a)
CH0245146185	1.0000 % KBAARG 1 06/19/23	560	0	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245863987	1.5000 % PFZENT 1 1/2 02/05/29 450	1'250	700	0	1'950 CHF	100.73%	1'964'235.00	0.07	a)
CH0247611269	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 07/22/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247754382	1.6250 % GENEVA 1 5/8 07/30/29	500	1'000	0	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.05	a)
CH0247902890	1.0000 % TTEFP 1 08/29/24 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0247902916	1.2500 % WFC 1 1/4 09/03/24 EMTN	0	700	700	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.
CH0248166669	0.8750 % NRW 0 7/8 07/29/24 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0248209642	1.0000 % PFZENT 1 12/18/23 452	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249088136	1.0000 % PSHYPO 1 05/21/24 596	2'790	0	2'790	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0249483659	1.0000 % GENEVA 1 09/29/26	720	560	0	1'280 CHF	99.30%	1'271'040.00	0.05	a)
CH0249483683	1.0000 % SRENVX 1 09/17/24 155	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0251885791	0.7500 % KUNTA 0 3/4 09/17/24 EMTN	300	100	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252510414	1.2500 % BERN 1 1/4 09/12/30	780	150	0	930 CHF	99.90%	929'070.00	0.03	a)
CH0252511925	0.8750 % LFBANK 0 7/8 09/16/24 EMTN	500	1'000	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0252903726	1.0000 % KTBL 1 03/30/27	780	950	0	1'730 CHF	99.45%	1'720'485.00	0.06	a)
CH0252903767	1.3750 % KTBL 1 3/8 09/29/34	1'700	1'000	0	2'700 CHF	101.20%	2'732'400.00	0.10	a)
CH0253225954	0.8750 % EBN 0 7/8 09/22/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253243353	1.1250 % EGW 1 1/8 09/24/29 50	550	0	550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253609231	0.7500 % PFZENT 0 3/4 04/15/24 454	1'300	0	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0253612581	1.0000 % ZURCTY 1 03/30/27	200	1'000	0	1'200 CHF	99.40%	1'192'800.00	0.04	a)
CH0253612763	1.3750 % BIENNE 1 3/8 09/24/29	830	1'900	0	2'730 CHF	99.80%	2'724'540.00	0.10	a)
CH0254212233	1.0000 % ZURICH 1 10/06/27	1'670	500	0	2'170 CHF	99.35%	2'155'895.00	0.08	a)
CH0255475292	1.0000 % LISNSW 1 10/08/24	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0255678333	1.0000 % PSHYPO 1 07/07/26 598	1'300	600	0	1'900 CHF	99.22%	1'885'180.00	0.07	a)
CH0255678341	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 599	1'300	3'550	0	4'850 CHF	99.65%	4'833'025.00	0.17	a)
CH0255893072	0.5000 % ACACB 0 1/2 03/16/27 EMTN	300	0	0	300 CHF	97.30%	291'900.00	0.01	a)
CH0256434603	0.7500 % PFZENT 0 3/4 09/23/24 456	2'220	0	2'220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258404455	0.7500 % Q 0 3/4 11/21/24 EMTN	0	200	0	200 CHF	99.39%	198'780.00	0.01	a)
CH0258586384	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/23/24 600	3'450	0	3'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0258586392	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 11/09/35 601	550	0	0	550 CHF	100.27%	551'485.00	0.02	a)
CH0259810585	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 457	0	600	0	600 CHF	99.50%	597'000.00	0.02	a)
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	690	200	0	890 CHF	97.85%	870'865.00	0.03	a)
CH0260515769	0.6250 % SOLEUR 0 5/8 12/13/24	200	130	0	330 CHF	99.30%	327'690.00	0.01	a)
CH0261541863	0.8750 % LUGANO 0 7/8 12/09/24	810	100	0	910 CHF	99.39%	904'449.00	0.03	a)
CH0261561382	0.5000 % VAUD 0 1/2 12/18/24	830	200	0	1'030 CHF	99.20%	1'021'760.00	0.04	a)
CH0261627415	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/05/40 602	1'580	0	0	1'580 CHF	100.34%	1'585'372.00	0.06	a)
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	1'350	0	0	1'350 CHF	96.50%	1'302'750.00	0.05	a)
CH0262881441	0.7500 % SRENVX 0 3/4 01/21/27	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432970	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/20/23 458	2'780	0	2'780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0263432988	1.0000 % PFZENT 1 09/22/28 459	5'280	3'560	0	8'840 CHF	98.50%	8'707'400.00	0.31	a)
CH0264227015	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 03/19/25 603	3'220	170	0	3'390 CHF	99.13%	3'360'507.00	0.12	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	1'170	650	0	1'820 CHF	99.06%	1'802'892.00	0.06	a)
CH0266307377	0.6250 % BERN 0 5/8 02/11/32	670	120	0	790 CHF	95.00%	750'500.00	0.03	a)
CH0267222310	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/21/30 604	3'080	1'600	0	4'680 CHF	94.57%	4'425'876.00	0.16	a)
CH0267855986	0.1250 % KTBL 0 1/8 02/26/26	600	700	0	1'300 CHF	97.85%	1'272'050.00	0.05	a)
CH0267855994	0.6250 % KTBL 0 5/8 02/26/36	450	0	0	450 CHF	92.05%	414'225.00	0.01	a)
CH0267856000	0.1250 % GENCTY 0 1/8 02/12/25	200	500	0	700 CHF	98.65%	690'550.00	0.02	a)
CH0268100226	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/23/35	860	0	0	860 CHF	91.90%	790'340.00	0.03	a)
CH0268786982	0.6250 % PFZENT 0 5/8 02/12/30 460	2'700	1'300	0	4'000 CHF	95.93%	3'837'200.00	0.14	a)
CH0268988182	1.0000 % SCMNVX 1 04/17/35	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0269697931	0.3750 % KBSH 0 3/8 02/16/27	720	700	0	1'420 CHF	96.80%	1'374'560.00	0.05	a)
CH0269699176	0.3750 % GLRNKB 0 3/8 02/26/27	0	1'100	0	1'100 CHF	96.80%	1'064'800.00	0.04	a)
CH0269796212	0.5000 % THURBK 0 1/2 02/16/29	780	1'000	0	1'780 CHF	95.55%	1'700'790.00	0.06	a)
CH0270017830	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 03/04/27	1'240	0	0	1'240 CHF	96.60%	1'197'840.00	0.04	a)
CH0270190983	0.2500 % NOVNVX 0 1/4 05/13/25	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270190991	0.6250 % NOVNVX 0 5/8 11/13/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0270373803	1.0000 % SOLEUR 1 02/20/45	1'890	0	0	1'890 CHF	94.10%	1'778'490.00	0.06	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'240	0	0	1'240 CHF	97.25%	1'205'900.00	0.04	a)
CH0270586206	0.6250 % LAUSAN 0 5/8 03/04/30	670	30	0	700 CHF	95.70%	669'900.00	0.02	a)
CH0271171685	0.3750 % AAPL 0 3/8 11/25/24	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271171693	0.7500 % AAPL 0 3/4 02/25/30	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	3'390	1'370	0	4'760 CHF	96.66%	4'601'016.00	0.16	a)
CH0271288554	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 05/07/35 606	1'500	200	0	1'700 CHF	93.97%	1'597'490.00	0.06	a)
CH0271819812	0.5000 % ZUGKAN 0 1/2 03/03/27	640	560	0	1'200 CHF	97.20%	1'166'400.00	0.04	a)
CH0272154177	1.0000 % KTBL 1 03/05/40	980	0	0	980 CHF	94.85%	929'530.00	0.03	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	2'280	2'870	0	5'150 CHF	98.92%	5'094'380.00	0.18	a)
CH0273485398	0.6250 % PFZENT 0 5/8 07/16/29 462	3'750	150	0	3'900 CHF	96.34%	3'757'260.00	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.
CH0274253514	0.6000 % KBFRIB 0.6 04/09/27	500	360	0	860 CHF	97.30%	836'780.00	0.03	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	1'250	500	0	1'750 CHF	97.35%	1'703'625.00	0.06	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	800	1'770	0	2'570 CHF	98.74%	2'537'618.00	0.09	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	700	250	0	950 CHF	96.85%	920'075.00	0.03	a)
CH0276423818	0.6250 % GRKPSW 0 5/8 04/20/29	0	1'945	0	1'945 CHF	95.85%	1'864'282.50	0.07	a)
CH0276801476	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 04/25/33 608	2'660	1'700	0	4'360 CHF	93.10%	4'059'160.00	0.14	a)
CH0278346769	0.2500 % NADB 0 1/4 04/30/25	400	1'000	0	1'400 CHF	98.56%	1'379'840.00	0.05	a)
CH0278667107	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/12/24 463	2'520	0	2'520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0278667115	0.5000 % PFZENT 0 1/2 04/30/30 464	2'330	1'000	0	3'330 CHF	95.03%	3'164'499.00	0.11	a)
CH0279720343	0.2500 % KBBL 0 1/4 05/13/25	500	450	0	950 CHF	98.48%	935'560.00	0.03	a)
CH0280063493	0.9000 % TRANS 0.9 05/21/35	830	400	0	1'230 CHF	91.65%	1'127'295.00	0.04	a)
CH0280569093	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/04/23 609	1'830	0	1'830	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280569135	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/34 610	2'050	1'550	0	3'600 CHF	92.47%	3'328'920.00	0.12	a)
CH0280737518	0.1250 % EGW 0 1/8 05/27/25 51	560	800	1'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0280737542	0.3750 % EGW 0 3/8 05/27/30 52	720	800	1'520	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0281835485	0.3750 % THURGO 0 3/8 06/12/25	800	0	0	800 CHF	98.79%	790'320.00	0.03	a)
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	2'220	1'040	0	3'260 CHF	92.84%	3'026'584.00	0.11	a)
CH0282528907	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/45 612	1'550	430	0	1'980 CHF	91.50%	1'811'700.00	0.06	a)
CH0282857868	0.2500 % KTBL 0 1/4 06/24/24	720	750	1'470	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0282857876	0.7500 % KTBL 0 3/4 06/24/32	710	250	0	960 CHF	95.85%	920'160.00	0.03	a)
CH0283727367	0.5000 % BQTESS 0 1/2 06/24/24	450	0	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687404	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/24/25 613	3'100	280	3'380	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0284687412	1.0000 % PSHYPO 1 05/12/32 614	1'600	2'100	0	3'700 CHF	96.87%	3'584'190.00	0.13	a)
CH0284687420	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 06/19/42 615	1'220	0	0	1'220 CHF	94.18%	1'148'996.00	0.04	a)
CH0284915896	0.6250 % KBSCHW 0 5/8 07/02/25	500	600	0	1'100 CHF	98.82%	1'087'020.00	0.04	a)
CH0284950505	1.1250 % ZURCTY 1 1/8 06/26/40	610	250	0	860 CHF	97.05%	834'630.00	0.03	a)
CH0285597370	0.6250 % KOMMUN 0 5/8 07/09/27 EMTN	760	700	0	1'460 CHF	98.10%	1'432'260.00	0.05	a)
CH0285849367	0.6250 % PFZENT 0 5/8 06/30/27 466	2'220	2'250	0	4'470 CHF	97.73%	4'368'531.00	0.16	a)
CH0288286385	0.5000 % PFZENT 0 1/2 07/28/25 467	2'600	100	0	2'700 CHF	98.74%	2'665'980.00	0.09	a)
CH0290007134	0.3750 % KBBS 0 3/8 08/10/23	1'360	0	1'360	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0290876512	0.6250 % LUGANO 0 5/8 09/01/25	500	200	0	700 CHF	98.80%	691'600.00	0.02	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	300	2'300	0	2'600 CHF	98.15%	2'551'900.00	0.09	a)
CH0292365084	0.6250 % EGW 0 5/8 09/07/33 53	300	400	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0292877898	0.8750 % RDSALN 0 7/8 08/21/28 EMTN	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0293026222	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 05/16/31 617	3'100	1'500	0	4'600 CHF	94.90%	4'365'400.00	0.16	a)
CH0295186388	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/15/25 469	2'780	0	0	2'780 CHF	98.43%	2'736'354.00	0.10	a)
CH0296231951	0.3500 % NIEDOE 0.35 09/22/23	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297132349	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 10/15/25 618	5'660	1'300	0	6'960 CHF	98.37%	6'846'552.00	0.24	a)
CH0297132364	1.0000 % PSHYPO 1 01/25/36 619	1'250	500	0	1'750 CHF	94.84%	1'659'700.00	0.06	a)
CH0297343557	0.0000 % SOLEUR 0 10/16/23	390	0	390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0297343565	0.5000 % SOLEUR 0 1/2 10/16/30	770	0	0	770 CHF	95.15%	732'655.00	0.03	a)
CH0297974898	1.0000 % KO 1 10/02/28	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0299297280	0.7500 % ZKB 0 3/4 10/28/30 135	1'280	0	0	1'280 CHF	95.30%	1'219'840.00	0.04	a)
CH0299477361	0.6250 % LGT 0 5/8 11/25/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300417273	0.0400 % NEUNBG 0.04 11/11/24	390	100	0	490 CHF	98.95%	484'855.00	0.02	a)
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	2'910	800	3'710	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0300874283	0.6250 % PFZENT 0 5/8 11/01/30 471	2'200	0	0	2'200 CHF	95.34%	2'097'480.00	0.07	a)
CH0301549348	0.2500 % STAAKA 0 1/4 11/17/25 EMTN	750	550	0	1'300 CHF	97.85%	1'272'050.00	0.05	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	3'000	1'000	0	4'000 CHF	95.76%	3'830'400.00	0.14	a)
CH0302790131	0.0200 % GENEVA 0.02 11/27/24	670	580	0	1'250 CHF	98.91%	1'236'375.00	0.04	a)
CH0302790149	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/27/30	0	200	0	200 CHF	95.10%	190'200.00	0.01	a)
CH0303196148	0.2500 % GRAUBU 0 1/4 11/26/27	1'260	600	0	1'860 CHF	96.50%	1'794'900.00	0.06	a)
CH0304755157	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 11/28/34 623	2'280	1'070	0	3'350 CHF	93.15%	3'120'525.00	0.11	a)
CH0305398247	0.2500 % ACACB 0 1/4 06/18/26 EMTN	900	250	0	1'150 CHF	97.20%	1'117'800.00	0.04	a)
CH0305398254	0.1250 % CM 0 1/8 12/22/25 EMTN	990	550	0	1'540 CHF	97.45%	1'500'730.00	0.05	a)
CH0305765775	0.3000 % WINCTY 0.3 12/10/27	500	0	0	500 CHF	96.25%	481'250.00	0.02	a)
CH0305954569	0.2500 % ARGOVI 0 1/4 12/11/29	200	450	0	650 CHF	94.65%	615'225.00	0.02	a)
CH0306173722	0.0000 % PFZENT 0 07/25/23 472	2'440	0	2'440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0306173730	0.1250 % PFZENT 0 1/8 02/25/26 473	2'110	500	0	2'610 CHF	97.60%	2'547'360.00	0.09	a)
CH0306173748	0.5000 % PFZENT 0 1/2 09/20/30 474	3'520	720	0	4'240 CHF	94.66%	4'013'584.00	0.14	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	0	55	55	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.
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'700	400	0	3'100 CHF	95.84%	2'971'040.00	0.11	a)
CH0307256450	0.6000 % PFZENT 0.6 12/11/35 476	3'610	0	0	3'610 CHF	90.67%	3'273'187.00	0.12	a)
CH0310175564	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/05/26 625	3'250	1'700	0	4'950 CHF	97.57%	4'829'715.00	0.17	a)
CH0310175598	0.1000 % ACACB 0.1 01/26/26 EMTN	500	500	0	1'000 CHF	97.45%	974'500.00	0.03	a)
CH0310451858	1.2500 % UBS 1 1/4 02/23/26	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0310646523	0.5000 % KBFRIB 0 1/2 02/23/28	720	150	0	870 CHF	96.05%	835'635.00	0.03	a)
CH0312512715	0.5000 % PFZENT 0 1/2 03/30/34 478	3'020	0	0	3'020 CHF	91.12%	2'751'824.00	0.10	a)
CH0312512731	0.3200 % EGW 0.32 05/09/36 54	720	500	1'220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0313130061	0.2500 % KBSCHW 0 1/4 02/19/26	280	800	0	1'080 CHF	97.60%	1'054'080.00	0.04	a)
CH0315593928	0.4000 % GENEVA 0.4 04/28/36	1'140	500	0	1'640 CHF	89.20%	1'462'880.00	0.05	a)
CH0315955903	0.3040 % CAF 0.304 09/16/24 EMTN	250	0	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403744	0.0500 % PFZENT 0.05 11/06/26 480	2'330	2'400	0	4'730 CHF	96.66%	4'572'018.00	0.16	a)
CH0319403751	0.1250 % ZKB 0 1/8 05/13/26 138	900	550	0	1'450 CHF	97.10%	1'407'950.00	0.05	a)
CH0319403769	0.2500 % NIDKBN 0 1/4 05/27/26	700	0	0	700 CHF	97.15%	680'050.00	0.02	a)
CH0319403777	0.3750 % PSPNSW 0 3/8 04/29/26	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319403785	0.3000 % PFZENT 0.3 06/06/31 481	3'110	3'800	0	6'910 CHF	92.60%	6'398'660.00	0.23	a)
CH0319415920	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/06/28 627	2'640	1'270	0	3'910 CHF	94.74%	3'704'334.00	0.13	a)
CH0319415938	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/32 628	1'830	1'050	0	2'880 CHF	92.41%	2'661'408.00	0.09	a)
CH0319415946	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 10/05/35 629	2'890	250	0	3'140 CHF	89.76%	2'818'464.00	0.10	a)
CH0319415961	0.8750 % GEOFIS 0 7/8 05/12/26	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0319416126	0.0400 % BERCTY 0.04 03/31/27	200	0	0	200 CHF	96.30%	192'600.00	0.01	a)
CH0319416134	0.5000 % BERCTY 0 1/2 03/31/36	940	0	0	940 CHF	90.60%	851'640.00	0.03	a)
CH0320712596	0.3000 % RAIFFS 0.3 04/22/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0323604188	0.3750 % THURBK 0 3/8 05/20/31	750	500	0	1'250 CHF	92.20%	1'152'500.00	0.04	a)
CH0323735628	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/15/27 631	2'490	2'000	0	4'490 CHF	95.59%	4'291'991.00	0.15	a)
CH0326213912	0.2500 % KISPIZ 0 1/4 07/28/28	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326213920	0.6000 % GENEVA 0.6 07/04/46	1'610	0	0	1'610 CHF	83.65%	1'346'765.00	0.05	a)
CH0326213953	0.7500 % KISPIZ 0 3/4 07/28/36	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0326371470	0.2970 % CARDEV 0.297 07/07/28	650	0	0	650 CHF	94.70%	615'550.00	0.02	a)
CH0328298069	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/08/39 632	2'640	500	0	3'140 CHF	84.96%	2'667'744.00	0.09	a)
CH0328599235	0.0600 % KBAARG 0.06 07/01/25	1'000	250	0	1'250 CHF	98.05%	1'225'625.00	0.04	a)
CH0328901100	0.4000 % TESSIN 0.4 06/27/44	1'070	1'000	0	2'070 CHF	80.65%	1'669'455.00	0.06	a)
CH0330143188	0.0200 % ZKB 0.02 08/16/27 139	1'400	1'350	0	2'750 CHF	95.40%	2'623'500.00	0.09	a)
CH0330938835	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 08/04/38 633	2'460	1'950	0	4'410 CHF	84.15%	3'711'015.00	0.13	a)
CH0330938892	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/25	390	500	0	890 CHF	97.90%	871'310.00	0.03	a)
CH0330938900	0.0000 % RHBSZS 0 09/01/31	500	0	0	500 CHF	91.00%	455'000.00	0.02	a)
CH0331455326	0.0000 % KTBS 0 09/05/23	330	0	330	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0331455334	0.0000 % KTBS 0 09/04/26	400	750	0	1'150 CHF	97.10%	1'116'650.00	0.04	a)
CH0331455342	0.0000 % KTBS 0 09/05/29	560	1'400	0	1'960 CHF	93.70%	1'836'520.00	0.07	a)
CH0336352742	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 07/15/31 635	900	2'730	0	3'630 CHF	91.24%	3'312'012.00	0.12	a)
CH0336352759	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 05/17/40 636	1'550	500	0	2'050 CHF	82.30%	1'687'150.00	0.06	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	2'390	1'070	0	3'460 CHF	79.26%	2'742'396.00	0.10	a)
CH0336352775	0.1250 % SCMNVX 0 1/8 09/15/32	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336352817	0.0400 % NIEDOE 0.04 10/23/26	280	450	0	730 CHF	96.55%	704'815.00	0.03	a)
CH0336587644	0.0200 % KBAARG 0.02 10/17/24	670	600	1'270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587669	0.0000 % PFZENT 0 06/14/24 482	2'390	0	2'390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0336587719	0.0000 % PFZENT 0 01/27/27 483	2'990	1'130	0	4'120 CHF	96.24%	3'965'088.00	0.14	a)
CH0336587727	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/02/31 484	1'800	500	0	2'300 CHF	91.06%	2'094'380.00	0.07	a)
CH0337645581	0.0000 % PFZENT 0 10/02/26 485	0	3'800	0	3'800 CHF	96.64%	3'672'320.00	0.13	a)
CH0338330415	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 09/23/32 639	1'650	1'170	0	2'820 CHF	89.67%	2'528'694.00	0.09	a)
CH0338330423	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 09/23/43 640	2'460	1'000	0	3'460 CHF	81.41%	2'816'786.00	0.10	a)
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	0	950	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0338330472	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/14/36 641	2'660	100	0	2'760 CHF	86.10%	2'376'360.00	0.08	a)
CH0340907929	0.1000 % KBSCHW 0.1 10/25/28	1'060	0	0	1'060 CHF	93.85%	994'810.00	0.04	a)
CH0341440318	0.4000 % ZURCTY 0.4 11/21/46	670	0	0	670 CHF	81.30%	544'710.00	0.02	a)
CH0341725916	0.5000 % GENEVA 0 1/2 10/31/56	1'000	0	0	1'000 CHF	77.65%	776'500.00	0.03	a)
CH0342587638	0.0500 % ZKB 0.05 11/23/26 140	910	1'000	0	1'910 CHF	96.35%	1'840'285.00	0.07	a)
CH0342587646	0.2000 % STGALN 0.2 11/28/41	930	0	0	930 CHF	81.20%	755'160.00	0.03	a)
CH0343366792	0.0500 % BERN 0.05 11/18/31	1'230	0	0	1'230 CHF	90.95%	1'118'685.00	0.04	a)
CH0344583791	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/21/25 488	2'790	0	0	2'790 CHF	98.61%	2'751'219.00	0.10	a)
CH0344583809	0.1250 % PFZENT 0 1/8 12/02/24 486	3'130	830	3'960	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.
CH0344583817	0.3750 % PFZENT 0 3/8 10/24/28 487	2'200	250	0	2'450 CHF	95.66%	2'343'670.00	0.08	a)
CH0344583833	0.4000 % EGW 0.4 12/09/31 55	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0344583841	0.2000 % SOLEUR 0.2 12/15/28	0	500	0	500 CHF	95.20%	476'000.00	0.02	a)
CH0344583866	0.1250 % UKB 0 1/8 11/27/26	650	750	0	1'400 CHF	96.40%	1'349'600.00	0.05	a)
CH0344958472	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55	7'230	8'750	0	15'980 CHF	93.25%	14'901'350.00	0.53	a)
CH0344958498	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/28/45	11'480	9'490	0	20'970 CHF	93.68%	19'644'696.00	0.70	a)
CH0344958688	0.5000 % SWISS 0 1/2 06/27/32	10'590	7'150	0	17'740 CHF	97.36%	17'271'664.00	0.61	a)
CH0346828434	0.3000 % NAB 0.3 10/31/25 GMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0347082783	0.2500 % ZKB 0 1/4 01/27/26 141	1'780	900	0	2'680 CHF	97.75%	2'619'700.00	0.09	a)
CH0347082809	0.3000 % KBFRIB 0.3 02/17/27	820	0	0	820 CHF	96.55%	791'710.00	0.03	a)
CH0347366038	0.3750 % ZUGKAN 0 3/8 12/15/27	0	545	0	545 CHF	96.20%	524'290.00	0.02	a)
CH0347556877	0.2500 % NBRNS 0 1/4 01/19/29	0	300	0	300 CHF	94.65%	283'950.00	0.01	a)
CH0347556885	0.3000 % MET 0.3 01/19/26 EMTN	900	1'270	0	2'170 CHF	97.55%	2'116'835.00	0.08	a)
CH0347556901	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/06/25 643	3'440	150	0	3'590 CHF	98.46%	3'534'714.00	0.13	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	0	2'870	0	2'870 CHF	96.26%	2'762'662.00	0.10	a)
CH0347556927	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/23/37 645	1'100	2'110	0	3'210 CHF	90.16%	2'894'136.00	0.10	a)
CH0352595885	0.3750 % PFZENT 0 3/8 09/21/27 489	2'750	800	0	3'550 CHF	96.72%	3'433'560.00	0.12	a)
CH0352595893	0.5000 % PFZENT 0 1/2 02/20/32 490	1'800	2'750	0	4'550 CHF	93.28%	4'244'240.00	0.15	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353105197	0.3750 % THURBK 0 3/8 02/08/28	650	0	0	650 CHF	96.00%	624'000.00	0.02	a)
CH0353428037	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 12/21/29 646	1'000	1'200	0	2'200 CHF	95.35%	2'097'700.00	0.07	a)
CH0353428052	0.3750 % ARGOVI 0 3/8 02/17/31	1'110	500	0	1'610 CHF	94.10%	1'515'010.00	0.05	a)
CH0353428060	0.5500 % ENELIM 0.55 09/03/24 EMTN	0	10	10	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0353574319	0.3000 % KBBS 0.3 06/22/27	1'610	850	0	2'460 CHF	96.50%	2'373'900.00	0.08	a)
CH0353574327	0.0000 % KTBS 0 11/22/24	670	200	0	870 CHF	98.90%	860'430.00	0.03	a)
CH0353945378	0.0100 % ZURICH 0.01 09/07/26	400	1'100	0	1'500 CHF	97.00%	1'455'000.00	0.05	a)
CH0357483194	0.0500 % WINCTY 0.05 03/17/26	810	0	0	810 CHF	97.40%	788'940.00	0.03	a)
CH0357676110	0.8750 % ALLNSW 0 7/8 03/30/27	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676151	0.0100 % PFZENT 0.01 02/05/24 491	2'530	0	2'530	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0357676169	0.3750 % PFZENT 0 3/8 12/07/26 492	3'020	1'900	0	4'920 CHF	97.43%	4'793'556.00	0.17	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	4'740	1'330	0	6'070 CHF	95.47%	5'795'029.00	0.21	a)
CH0357676235	0.1500 % GLRNKB 0.15 09/26/25	0	500	0	500 CHF	97.80%	489'000.00	0.02	a)
CH0358654942	0.6000 % GENEVA 0.6 03/24/38	600	500	0	1'100 CHF	89.85%	988'350.00	0.04	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0360172768	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/18/27 647	3'710	1'430	0	5'140 CHF	96.97%	4'984'258.00	0.18	a)
CH0360677287	0.5000 % LGT 0 1/2 05/12/27	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	3'550	1'100	0	4'650 CHF	96.59%	4'491'435.00	0.16	a)
CH0361532903	0.7500 % KSAARA 0 3/4 05/28/32 0	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361532911	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/12/26 495	2'220	600	0	2'820 CHF	97.65%	2'753'730.00	0.10	a)
CH0361532960	0.3750 % EGW 0 3/8 06/22/32 56	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533067	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/01/25 496	2'370	600	0	2'970 CHF	98.06%	2'912'382.00	0.10	a)
CH0361533117	0.6250 % NEDWBK 0 5/8 08/21/37 EMTN	760	200	0	960 CHF	91.15%	875'040.00	0.03	a)
CH0361533125	0.6250 % KUNTA 0 5/8 08/06/38 EMTN	630	0	0	630 CHF	90.45%	569'835.00	0.02	a)
CH0361533166	0.6000 % EGW 0.6 09/14/35 57	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0361533174	0.5000 % BQNCHT 0 1/2 09/30/27	630	150	0	780 CHF	96.50%	752'700.00	0.03	a)
CH0361533232	0.8750 % LAUSAN 0 7/8 10/06/42	560	250	0	810 CHF	89.20%	722'520.00	0.03	a)
CH0362748276	0.2000 % NADB 0.2 10/26/27	550	250	0	800 CHF	95.65%	765'200.00	0.03	a)
CH0362748292	0.5500 % ZURCTY 0.55 05/08/37	300	250	0	550 CHF	90.10%	495'550.00	0.02	a)
CH0362748326	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/25/24 648	2'660	0	2'660	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0362748342	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 01/25/35 649	1'800	130	0	1'930 CHF	91.62%	1'768'266.00	0.06	a)
CH0362748359	0.3750 % SCMNFX 0 3/8 05/31/27	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0364277415	0.6250 % BERCTY 0 5/8 06/13/39	640	0	0	640 CHF	89.40%	572'160.00	0.02	a)
CH0365501474	0.5000 % C 0 1/2 11/22/24 EMTN	0	75	75	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0368172877	0.3000 % BQTESS 0.3 06/15/27	800	200	0	1'000 CHF	95.85%	958'500.00	0.03	a)
CH0368306871	0.1250 % LUCERN 0 1/8 06/20/29	250	845	0	1'095 CHF	94.50%	1'034'775.00	0.04	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0370634633	0.1700 % EIBKOR 0.17 07/18/25 GMTN	830	765	0	1'595 CHF	98.07%	1'564'216.50	0.06	a)
CH0370943547	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/20/26 651	1'700	2'500	0	4'200 CHF	97.22%	4'083'240.00	0.15	a)
CH0370943554	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/39 652	500	965	0	1'465 CHF	88.07%	1'290'225.50	0.05	a)
CH0373476040	0.5000 % BCSW 0 1/2 11/28/25	0	300	300	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.
CH0373476073	0.3750 % PFZENT 0 3/8 07/24/28 497	2'300	260	0	2'560 CHF	95.90%	2'455'040.00	0.09	a)
CH0373476107	0.7000 % ZURCTY 0.7 11/24/39	0	500	0	500 CHF	90.90%	454'500.00	0.02	a)
CH0373476164	0.7500 % SCMNFX 0 3/4 11/24/33	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476198	0.2500 % PFZENT 0 1/4 12/06/27 498	3'410	0	0	3'410 CHF	96.07%	3'275'987.00	0.12	a)
CH0373476214	0.3750 % BAERVX 0 3/8 12/06/24	0	225	225	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476222	0.7500 % ALLNSW 0 3/4 06/19/26 0	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476263	0.5000 % EGW 0 1/2 03/09/34 58	500	520	1'020	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476339	0.3000 % ZKB 0.3 01/25/28 142	1'220	700	0	1'920 CHF	95.75%	1'838'400.00	0.07	a)
CH0373476370	0.6250 % SCHSOB 0 5/8 02/15/35	0	300	0	300 CHF	92.25%	276'750.00	0.01	a)
CH0373476412	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/19/28 499	3'000	1'640	0	4'640 CHF	96.63%	4'483'632.00	0.16	a)
CH0373476420	0.6500 % PFZENT 0.65 02/15/33 500	1'780	2'150	0	3'930 CHF	93.57%	3'677'301.00	0.13	a)
CH0373476438	0.3000 % GRKPSW 0.3 02/20/26	0	1'650	0	1'650 CHF	97.70%	1'612'050.00	0.06	a)
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	400	0	0	400 CHF	98.50%	394'000.00	0.01	a)
CH0373476693	0.5000 % PFZENT 0 1/2 11/24/28 501	3'500	2'460	0	5'960 CHF	96.20%	5'733'520.00	0.20	a)
CH0373476727	0.7700 % EGW 0.77 05/16/33 59	390	0	390	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0373476784	0.5000 % KBSh 0 1/2 05/31/28	550	1'400	0	1'950 CHF	96.00%	1'872'000.00	0.07	a)
CH0373476933	0.0000 % ZURICH 0 06/27/25 0	830	800	0	1'630 CHF	98.31%	1'602'453.00	0.06	a)
CH0373476966	0.7500 % PFZENT 0 3/4 06/21/33 502	1'440	900	0	2'340 CHF	94.13%	2'202'642.00	0.08	a)
CH0373945036	0.2500 % ACACB 0 1/4 07/27/27 EMTN	600	1'400	0	2'000 CHF	96.15%	1'923'000.00	0.07	a)
CH0373945044	0.3750 % JXN 0 3/8 07/18/25 EMTN	940	200	0	1'140 CHF	97.90%	1'116'060.00	0.04	a)
CH0373945085	0.3000 % STAAKA 0.3 10/08/29 EMTN	1'080	200	0	1'280 CHF	94.05%	1'203'840.00	0.04	a)
CH0373945093	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/12/27 653	3'530	1'000	0	4'530 CHF	96.16%	4'356'048.00	0.15	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	105	105	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268755	0.0000 % SOLEUR 0 10/27/25	200	550	0	750 CHF	97.75%	733'125.00	0.03	a)
CH0379354225	0.2500 % KBAARG 0 1/4 09/07/26 0	800	450	0	1'250 CHF	97.10%	1'213'750.00	0.04	a)
CH0379610980	0.5000 % BERN 0 1/2 09/28/37	560	1'600	0	2'160 CHF	89.65%	1'936'440.00	0.07	a)
CH0380011574	0.6000 % STGALL 0.6 09/21/37	360	450	0	810 CHF	90.05%	729'405.00	0.03	a)
CH0383104335	0.2500 % NESNVX 0 1/4 10/04/27 EMTN	0	320	320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0384125065	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 09/18/26 654	2'660	800	0	3'460 CHF	97.31%	3'366'926.00	0.12	a)
CH0384125073	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/18/30 655	1'250	0	0	1'250 CHF	95.38%	1'192'250.00	0.04	a)
CH0384125081	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 10/18/38 656	850	30	0	880 CHF	90.50%	796'400.00	0.03	a)
CH0384629892	1.0000 % DOKASW 1 10/13/25	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0385518045	0.4000 % CBAAU 0.4 09/25/26 EMTN	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0386949314	0.5500 % MUNHYP 0.55 11/22/32 EMTN	740	30	0	770 CHF	91.70%	706'090.00	0.03	a)
CH0386949348	0.3000 % CDCEPS 0.3 11/12/27 EMTN	800	600	0	1'400 CHF	96.35%	1'348'900.00	0.05	a)
CH0387879031	0.2500 % GENEVA 0 1/4 11/29/27	560	1'000	0	1'560 CHF	96.40%	1'503'840.00	0.05	a)
CH0387879049	0.5000 % GENEVA 0 1/2 11/28/31	1'400	500	0	1'900 CHF	93.90%	1'784'100.00	0.06	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0387879072	0.0100 % TESSIN 0.01 12/22/25	940	0	0	940 CHF	97.55%	916'970.00	0.03	a)
CH0387879080	0.2500 % LUGANO 0 1/4 12/20/27	630	0	0	630 CHF	95.95%	604'485.00	0.02	a)
CH0391491518	0.2500 % BCVAUD 0 1/4 11/28/25	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0391911770	0.3750 % VALIAN 0 3/8 12/06/27	0	1'665	0	1'665 CHF	95.40%	1'588'410.00	0.06	a)
CH0392885734	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/27/26 657	1'000	2'900	0	3'900 CHF	97.69%	3'809'910.00	0.14	a)
CH0392885791	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 08/07/24	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0392885809	0.3750 % BQTESS 0 3/8 02/08/28	670	200	0	870 CHF	95.30%	829'110.00	0.03	a)
CH0394905712	0.0000 % KTBS 0 09/24/25	560	900	0	1'460 CHF	98.00%	1'430'800.00	0.05	a)
CH0397450724	0.2500 % KBBL 0 1/4 01/25/27	1'000	550	0	1'550 CHF	96.65%	1'498'075.00	0.05	a)
CH0398633278	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/16/25 503	1'400	0	0	1'400 CHF	98.52%	1'379'280.00	0.05	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	580	735	0	1'315 CHF	97.10%	1'276'865.00	0.05	a)
CH0398633484	0.2500 % PFZENT 0 1/4 07/20/26 504	0	1'350	0	1'350 CHF	97.47%	1'315'845.00	0.05	a)
CH0398633492	0.7500 % PFZENT 0 3/4 10/01/32 505	2'620	750	0	3'370 CHF	94.71%	3'191'727.00	0.11	a)
CH0398633534	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 10/27/28 0	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633542	1.0000 % ZURNVX 1 10/30/28 0	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633567	0.1250 % PFZENT 0 1/8 10/31/24 506	1'400	100	1'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633575	0.6250 % PFZENT 0 5/8 03/08/29 507	3'320	1'100	0	4'420 CHF	96.61%	4'270'162.00	0.15	a)
CH0398633591	0.4000 % GLRNKB 0.4 11/30/26	0	600	0	600 CHF	97.05%	582'300.00	0.02	a)
CH0398633641	0.7500 % EGW 0 3/4 11/29/32 60	560	0	560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398633799	0.1500 % ZKB 0.15 01/25/27 144	550	100	0	650 CHF	96.40%	626'600.00	0.02	a)
CH0398677671	0.6500 % STAAKA 0.65 02/08/44 EMTN	830	0	0	830 CHF	83.70%	694'710.00	0.02	a)
CH0398677713	0.3140 % CABEI 0.314 09/05/24 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0398678927	0.5000 % WSTP 0 1/2 05/16/28 EMTN	0	1'150	1'150	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.
CH0398913498	0.2000 % KBFRIB 0.2 02/20/26	500	1'500	0	2'000 CHF	97.40%	1'948'000.00	0.07	a)
CH0401007346	0.2530 % EIBKOR 0.253 03/06/23 EMTN	780	0	780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0401956823	1.1000 % LAUSAN 1.1 03/15/38	400	730	0	1'130 CHF	95.10%	1'074'630.00	0.04	a)
CH0401956880	0.2500 % ACACB 0 1/4 12/08/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	97.85%	782'800.00	0.03	a)
CH0404322205	0.5500 % ZUGKAN 0.55 03/08/28	1'320	0	0	1'320 CHF	96.45%	1'273'140.00	0.05	a)
CH0405985836	0.7000 % THURBK 0.7 03/22/30 0	700	0	0	700 CHF	95.60%	669'200.00	0.02	a)
CH0405986057	0.2500 % KBAARG 0 1/4 04/03/25	1'100	800	0	1'900 CHF	98.59%	1'873'210.00	0.07	a)
CH0406415247	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 04/26/24 658	900	0	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0406415262	0.1500 % WINCTY 0.15 03/26/25	390	400	0	790 CHF	98.61%	779'019.00	0.03	a)
CH0406415304	0.2000 % LFBANK 0.2 04/17/26 EMTN	560	550	0	1'110 CHF	97.30%	1'080'030.00	0.04	a)
CH0406990835	0.6000 % SIKASW 0.6 03/27/26	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0407153359	0.3750 % KBBL 0 3/8 03/23/26 EMTN	800	300	0	1'100 CHF	97.85%	1'076'350.00	0.04	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	680	0	0	680 CHF	98.56%	670'208.00	0.02	a)
CH0409606347	0.2500 % TESSIN 0 1/4 05/08/28	490	0	0	490 CHF	95.90%	469'910.00	0.02	a)
CH0413618346	0.1000 % CM 0.1 04/30/25 EMTN	1'220	500	0	1'720 CHF	98.22%	1'689'384.00	0.06	a)
CH0413618361	1.1000 % KSBAAR 1.1 05/23/33	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0414510062	0.2500 % CDCEPS 0 1/4 05/30/25 EMTN	800	0	0	800 CHF	98.50%	788'000.00	0.03	a)
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086078	0.3030 % KDB 0.303 06/14/23 EMTN	280	0	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0417086086	0.5000 % MUNHYP 0 1/2 06/14/28 EMTN	1'580	900	0	2'480 CHF	96.10%	2'383'280.00	0.08	a)
CH0419040727	0.2000 % VALIAN 0.2 01/29/27	0	900	0	900 CHF	95.80%	862'200.00	0.03	a)
CH0419040776	0.7000 % BERCTY 0.7 01/30/34	610	1'200	0	1'810 CHF	94.55%	1'711'355.00	0.06	a)
CH0419040784	0.2500 % KBBL 0 1/4 08/04/27	1'000	300	0	1'300 CHF	96.10%	1'249'300.00	0.04	a)
CH0419040792	0.7500 % ZURNVX 0 3/4 10/22/27	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419040842	0.5500 % PFZENT 0.55 01/29/31 508	3'450	1'350	0	4'800 CHF	94.65%	4'543'200.00	0.16	a)
CH0419040891	0.5000 % KTBS 0 1/2 02/22/34	300	200	0	500 CHF	93.00%	465'000.00	0.02	a)
CH0419040925	1.0500 % LAUSAN 1.05 03/07/44	500	40	0	540 CHF	91.15%	492'210.00	0.02	a)
CH0419040941	0.3000 % PFZENT 0.3 04/09/29 509	2'550	3'300	0	5'850 CHF	94.95%	5'554'575.00	0.20	a)
CH0419040958	0.7000 % PFZENT 0.7 03/04/39 510	1'580	500	0	2'080 CHF	89.57%	1'863'056.00	0.07	a)
CH0419040990	1.2500 % SPSNSW 1 1/4 04/02/27	0	420	420	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041006	0.1500 % KBBS 0.15 04/02/27	750	1'250	0	2'000 CHF	96.30%	1'926'000.00	0.07	a)
CH0419041055	0.1000 % GEBNVX 0.1 10/17/24 55Y	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041063	0.6000 % GEBNVX 0.6 10/17/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041071	0.6250 % BIENNE 0 5/8 04/12/27	1'670	200	0	1'870 CHF	97.45%	1'822'315.00	0.06	a)
CH0419041089	1.0300 % BIENNE 1.03 04/12/34	220	0	0	220 CHF	95.15%	209'330.00	0.01	a)
CH0419041147	0.3750 % KBBL 0 3/8 05/13/30	0	3'200	0	3'200 CHF	93.55%	2'993'600.00	0.11	a)
CH0419041154	0.3500 % BERN 0.35 05/08/34	860	50	0	910 CHF	91.10%	829'010.00	0.03	a)
CH0419041162	0.0000 % PFZENT 0 06/23/25 511	0	1'000	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.03	a)
CH0419041170	0.2000 % PFZENT 0.2 09/10/29 512	2'500	1'050	0	3'550 CHF	93.90%	3'333'450.00	0.12	a)
CH0419041188	0.5000 % PFZENT 0 1/2 05/15/34 513	1'700	350	0	2'050 CHF	90.98%	1'865'090.00	0.07	a)
CH0419041212	0.4400 % EGW 0.44 05/28/37 61	760	330	1'090	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041220	0.5500 % PSPNSW 0.55 02/04/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041238	0.1250 % ZKB 0 1/8 06/06/29 145	700	0	0	700 CHF	93.25%	652'750.00	0.02	a)
CH0419041287	0.4000 % PGHNSW 0.4 06/21/27	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041303	0.3000 % NEUNBG 0.3 07/19/39	790	0	0	790 CHF	84.35%	666'365.00	0.02	a)
CH0419041337	0.0000 % VALIAN 0 07/31/29	0	2'400	0	2'400 CHF	91.15%	2'187'600.00	0.08	a)
CH0419041410	0.0000 % KBBS 0 08/23/34	750	0	0	750 CHF	85.15%	638'625.00	0.02	a)
CH0419041436	0.0000 % KBAARG 0 09/17/29	300	1'750	0	2'050 CHF	92.20%	1'890'100.00	0.07	a)
CH0419041469	0.0000 % PFZENT 0 09/10/37 514	550	760	0	1'310 CHF	81.74%	1'070'794.00	0.04	a)
CH0419041493	0.4000 % ALLNSW 0.4 09/26/29	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041592	0.0000 % SOONVX 0 10/11/29	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041600	0.4000 % SOONVX 0.4 10/11/34	0	160	160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0419041626	0.0000 % NIDKBK 0 11/05/29	0	40	0	40 CHF	91.55%	36'620.00	0.00	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMTN	980	0	980	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0423233516	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/17/25 659	5'500	800	0	6'300 CHF	98.09%	6'179'670.00	0.22	a)
CH0423233524	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/22/29 660	5'220	820	0	6'040 CHF	96.06%	5'802'024.00	0.21	a)
CH0423233540	0.3000 % NADB 0.3 07/24/26	610	0	0	610 CHF	97.30%	593'530.00	0.02	a)
CH0423233565	0.3000 % JXN 0.3 12/18/23 EMTN	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766521	1.1250 % SIKASW 1 1/8 07/12/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0425766539	0.2880 % TTEFP 0.288 07/13/26 EMTN	0	300	300	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.
CH0428194242	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 07/10/28 661	3'440	3'050	0	6'490 CHF	95.98%	6'229'102.00	0.22	a)
CH0428194259	1.0000 % PSHYPO 1 01/23/43 662	1'600	1'500	0	3'100 CHF	92.07%	2'854'170.00	0.10	a)
CH0433761274	1.0000 % HOLNSW 1 12/11/24	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0434678378	0.0000 % LUCERN 0 10/15/25	790	0	0	790 CHF	98.00%	774'200.00	0.03	a)
CH0434678394	0.6250 % PSHYPO 0 5/8 10/09/28 663	1'400	130	0	1'530 CHF	96.86%	1'481'958.00	0.05	a)
CH0434678402	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 664	0	2'100	0	2'100 CHF	94.27%	1'979'670.00	0.07	a)
CH0434678436	1.2000 % LAUSAN 1.2 10/26/37	280	320	0	600 CHF	96.70%	580'200.00	0.02	a)
CH0435590382	0.5000 % ACACB 0 1/2 10/03/28 EMTN	1'100	0	0	1'100 CHF	95.85%	1'054'350.00	0.04	a)
CH0437180935	0.7500 % SCMNVX 0 3/4 10/12/28	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965532	0.1000 % MUNHYP 0.1 10/31/24 EMTN	780	200	980	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0438965581	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 665	1'850	2'150	0	4'000 CHF	94.03%	3'761'200.00	0.13	a)
CH0440081393	0.0000 % SWISS 0 06/26/34	6'780	9'320	0	16'100 CHF	91.96%	14'805'560.00	0.53	a)
CH0440081401	0.0000 % SWISS 0 07/24/39	9'090	10'010	0	19'100 CHF	88.00%	16'808'000.00	0.60	a)
CH0440081567	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38	3'800	6'750	0	10'550 CHF	109.40%	11'541'700.00	0.41	a)
CH0441004410	0.7500 % NEUNBG 0 3/4 11/28/33	200	1'000	0	1'200 CHF	93.90%	1'126'800.00	0.04	a)
CH0441186456	1.0000 % BFCM 1 11/13/26 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186480	0.2500 % VORHYP 0 1/4 11/12/25 EMTN	350	330	680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0441186506	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 05/12/27 666	2'050	1'100	0	3'150 CHF	97.04%	3'056'760.00	0.11	a)
CH0441186514	0.2000 % BNS 0.2 11/19/25 EMTN	2'250	750	0	3'000 CHF	97.70%	2'931'000.00	0.10	a)
CH0443057515	0.5000 % THURBK 0 1/2 11/30/26	600	500	0	1'100 CHF	97.50%	1'072'500.00	0.04	a)
CH0444153792	0.5000 % KBAARG 0 1/2 11/15/27	870	0	0	870 CHF	96.70%	841'290.00	0.03	a)
CH0445625004	0.0000 % KTBS 0 11/28/23	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595610	0.8500 % MBGGR 0.85 11/14/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0446595677	0.3000 % GENEVA 0.3 11/27/26	1'000	0	0	1'000 CHF	97.35%	973'500.00	0.03	a)
CH0446595685	0.4000 % BLSNSW 0.4 12/12/28	400	310	0	710 CHF	96.20%	683'020.00	0.02	a)
CH0446595693	0.9500 % BLSNSW 0.95 12/12/39	0	550	0	550 CHF	94.90%	521'950.00	0.02	a)
CH0449619052	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 11/16/26 667	2'550	0	0	2'550 CHF	97.15%	2'477'325.00	0.09	a)
CH0451141417	0.9500 % ZURCTY 0.95 12/19/42	580	0	0	580 CHF	93.05%	539'690.00	0.02	a)
CH0457206750	0.4500 % ASBBNK 0.45 01/30/25 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0457206784	0.4500 % ACACB 0.45 01/24/29 EMTN	200	600	0	800 CHF	95.35%	762'800.00	0.03	a)
CH0457206826	0.3750 % ALTA 0 3/8 02/07/29 EMTN	0	100	0	100 CHF	95.50%	95'500.00	0.00	a)
CH0458097950	0.2500 % WSTP 0 1/4 01/29/27 EMTN	1'420	800	0	2'220 CHF	96.45%	2'141'190.00	0.08	a)
CH0459297435	0.8750 % UBS 0 7/8 01/30/25	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0459810534	0.1250 % KBAARG 0 1/8 02/11/26	300	300	0	600 CHF	97.45%	584'700.00	0.02	a)
CH0460054403	0.4500 % BQTESS 0.45 02/26/29	300	250	0	550 CHF	94.65%	520'575.00	0.02	a)
CH0460054429	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/19/43 668	1'950	0	0	1'950 CHF	89.96%	1'754'220.00	0.06	a)
CH0460054437	1.7200 % ARNDTN 1.72 03/05/26 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0460054452	0.2500 % MP 0 1/4 03/15/29 EMTN	0	250	0	250 CHF	94.65%	236'625.00	0.01	a)
CH0460872341	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 02/26/29 EMTN	400	200	0	600 CHF	93.95%	563'700.00	0.02	a)
CH0461238856	0.0000 % KORAIL 0 11/19/24 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238930	0.2500 % MIGBAN 0 1/4 12/10/27	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461238963	0.1000 % PFZENT 0.1 12/03/31 515	3'780	0	0	3'780 CHF	90.55%	3'422'790.00	0.12	a)
CH0461239011	0.2500 % NBRNS 0 1/4 12/06/39 EMTN	0	70	0	70 CHF	82.00%	57'400.00	0.00	a)
CH0461239029	0.1250 % VALIAN 0 1/8 12/04/34	0	945	0	945 CHF	84.65%	799'942.50	0.03	a)
CH0461239037	0.0500 % KBBS 0.05 12/19/33	1'100	0	0	1'100 CHF	86.65%	953'150.00	0.03	a)
CH0461239045	0.0500 % ZKB 0.05 02/05/31 146	500	0	0	500 CHF	90.60%	453'000.00	0.02	a)
CH0461239086	0.0500 % KBBL 0.05 01/28/31	1'500	1'240	0	2'740 CHF	90.60%	2'482'440.00	0.09	a)
CH0461239094	0.1110 % BZLNZ 0.111 07/24/28 EMTN	0	160	160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0461239136	0.1250 % PFZENT 0 1/8 03/23/32 516	2'780	0	0	2'780 CHF	90.35%	2'511'730.00	0.09	a)
CH0463112059	0.5500 % MUNHYP 0.55 03/15/34 EMTN	150	0	0	150 CHF	90.65%	135'975.00	0.00	a)
CH0465044631	0.7500 % BMW 0 3/4 09/03/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0465044649	0.1000 % WINCTY 0.1 03/20/28	490	600	0	1'090 CHF	95.05%	1'036'045.00	0.04	a)
CH0467182389	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 03/15/40 669	250	0	0	250 CHF	91.29%	228'225.00	0.01	a)
CH0467182405	0.7500 % C 0 3/4 04/02/26 EMTN	0	950	950	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0469273509	0.0000 % TESSIN 0 04/18/29	630	0	0	630 CHF	93.60%	589'680.00	0.02	a)
CH0469273541	1.1250 % CLNVX 1 1/8 04/15/26	0	60	60	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297918	0.0000 % PSHYPO 0 07/29/24 670	1'550	0	1'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0471297926	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/15/30 671	2'700	1'240	0	3'940 CHF	93.59%	3'687'446.00	0.13	a)
CH0471297959	0.2500 % NYLIFE 0 1/4 10/18/27 GMTN	2'340	0	0	2'340 CHF	95.35%	2'231'190.00	0.08	a)
CH0471297975	0.0000 % KTBS 0 05/30/25	500	500	0	1'000 CHF	98.36%	983'600.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0471297991	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 05/10/30 EMTN	750	0	0	750 CHF	92.35%	692'625.00	0.02	a)
CH0472691416	0.2500 % ACACB 0 1/4 10/24/29 EMTN	450	0	0	450 CHF	93.05%	418'725.00	0.01	a)
CH0474977698	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 05/08/29 672	0	2'620	0	2'620 CHF	93.98%	2'462'276.00	0.09	a)
CH0474977722	0.2525 % BAC 0.2525 06/12/26 EMTN	0	1'110	1'110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0477380916	0.2500 % KBFRIB 0 1/4 05/24/29	700	60	0	760 CHF	93.60%	711'360.00	0.03	a)
CH0479222066	0.2400 % BANCO 0.24 06/06/25 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514264	0.2000 % BFCM 0.2 06/12/26 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0479514298	0.2500 % RABOBK 0 1/4 11/25/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481013768	0.2000 % MUNHYP 0.2 06/18/31 EMTN	1'090	750	0	1'840 CHF	91.10%	1'676'240.00	0.06	a)
CH0481013800	0.1660 % TTEFP 0.166 12/21/29	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0481301031	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 06/27/30	780	210	0	990 CHF	91.90%	909'810.00	0.03	a)
CH0482172340	0.1250 % MET 0 1/8 06/11/27 EMTN	1'000	400	0	1'400 CHF	95.05%	1'330'700.00	0.05	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	2'110	2'250	0	4'360 CHF	92.02%	4'012'072.00	0.14	a)
CH0482172399	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/17/41 674	1'870	0	0	1'870 CHF	84.88%	1'587'256.00	0.06	a)
CH0482172407	0.3100 % GVAERO 0.31 06/27/29	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0483180938	0.0500 % BQTESS 0.05 07/10/29	920	30	0	950 CHF	91.90%	873'050.00	0.03	a)
CH0483181001	0.0000 % UBS 0 07/16/29 EMTN	300	100	0	400 CHF	92.00%	368'000.00	0.01	a)
CH0484360380	0.2500 % ZURICH 0 1/4 07/12/39	1'330	500	0	1'830 CHF	85.25%	1'560'075.00	0.06	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	2'550	0	0	2'550 CHF	95.76%	2'441'880.00	0.09	a)
CH0485252818	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/26/34 676	3'550	1'220	0	4'770 CHF	88.90%	4'240'530.00	0.15	a)
CH0485252826	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 01/25/44 677	1'150	0	0	1'150 CHF	83.49%	960'135.00	0.03	a)
CH0485252875	0.0000 % PSHYPO 0 08/26/49 678	3'110	460	0	3'570 CHF	69.65%	2'486'505.00	0.09	a)
CH0485260837	0.0000 % GLRNKB 0 10/16/29 000	0	1'000	0	1'000 CHF	92.00%	920'000.00	0.03	a)
CH0485260902	0.1000 % KBFRIB 0.1 11/01/44	1'560	0	0	1'560 CHF	74.00%	1'154'400.00	0.04	a)
CH0485261520	0.1250 % ZURCTY 0 1/8 04/20/28	560	0	0	560 CHF	95.55%	535'080.00	0.02	a)
CH0485261579	0.3750 % GENEVA 0 3/8 02/27/30	750	1'000	0	1'750 CHF	94.75%	1'658'125.00	0.06	a)
CH0485261603	0.3500 % EGW 0.35 04/27/40 63	760	800	1'560	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0485445982	0.0000 % NWIDE 0 07/11/25 EMTN	760	0	0	760 CHF	97.83%	743'508.00	0.03	a)
CH0485445990	0.1675 % NWIDE 0.1675 07/11/31 EMTN	830	0	0	830 CHF	90.35%	749'905.00	0.03	a)
CH0494734392	0.0000 % GENEVA 0 09/23/59	1'010	60	0	1'070 CHF	63.20%	676'240.00	0.02	a)
CH0494734400	0.0500 % LAUSAN 0.05 09/28/54	330	0	0	330 CHF	65.05%	214'665.00	0.01	a)
CH0496692978	0.0000 % BALHOL 0 09/25/26	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498400602	0.2500 % SOCGEN 0 1/4 10/08/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0498589032	0.1000 % NEUNBG 0.1 10/29/49	480	60	0	540 CHF	71.10%	383'940.00	0.01	a)
CH0502393355	0.0000 % PSHYPO 0 03/30/26 680	1'630	1'000	0	2'630 CHF	97.25%	2'557'675.00	0.09	a)
CH0503924414	0.5000 % C 0 1/2 11/01/28 EMTN	0	105	105	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0505011913	0.0000 % GENEVA 0 05/26/28	1'040	0	0	1'040 CHF	94.65%	984'360.00	0.03	a)
CH0505011921	0.1250 % GENEVA 0 1/8 05/28/32	0	750	0	750 CHF	90.80%	681'000.00	0.02	a)
CH0505011939	0.3000 % GENEVA 0.3 11/28/39	1'270	0	0	1'270 CHF	83.90%	1'065'530.00	0.04	a)
CH0506071106	0.0100 % KBAARG 0.01 02/18/30	830	750	0	1'580 CHF	91.60%	1'447'280.00	0.05	a)
CH0506071114	0.0000 % KBFRIB 0 02/26/30	720	850	0	1'570 CHF	91.45%	1'435'765.00	0.05	a)
CH0506071163	0.0000 % PFZENT 0 04/02/31 517	1'750	2'900	0	4'650 CHF	90.77%	4'220'805.00	0.15	a)
CH0506071171	0.0200 % PFZENT 0.02 01/30/40 518	1'430	0	0	1'430 CHF	79.33%	1'134'419.00	0.04	a)
CH0506071205	0.1500 % BNP 0.15 03/10/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071213	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/23/28	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071221	0.0000 % ZKB 0 03/12/30 147	1'500	0	0	1'500 CHF	91.60%	1'374'000.00	0.05	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	2'250	0	0	2'250 CHF	91.75%	2'064'375.00	0.07	a)
CH0506071288	0.0100 % KBAARG 0.01 06/29/28	200	300	0	500 CHF	94.05%	470'250.00	0.02	a)
CH0506071296	0.0000 % LUCERN 0 07/23/30	500	1'150	0	1'650 CHF	92.60%	1'527'900.00	0.05	a)
CH0506071346	0.0000 % CDCEPS 0 06/16/26 EMTN	600	200	0	800 CHF	96.90%	775'200.00	0.03	a)
CH0506071353	0.0000 % KBFRIB 0 02/05/31	690	500	0	1'190 CHF	89.80%	1'068'620.00	0.04	a)
CH0506071361	0.2000 % PSPNSW 0.2 02/04/31	0	165	165	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506071387	0.0000 % VALIAN 0 01/20/26	0	600	0	600 CHF	96.85%	581'100.00	0.02	a)
CH0506071395	0.2500 % KBBS 0 1/4 03/10/36	790	1'050	0	1'840 CHF	85.70%	1'576'880.00	0.06	a)
CH0506668836	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 11/18/27 EMTN	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0506668851	0.0000 % EIBKOR 0 05/27/25 EMTN	500	520	0	1'020 CHF	98.04%	1'000'008.00	0.04	a)
CH0508785711	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/14/31 681	900	550	0	1'450 CHF	90.80%	1'316'600.00	0.05	a)
CH0508785752	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 05/26/39	600	70	0	670 CHF	85.00%	569'500.00	0.02	a)
CH0510906891	0.1250 % ZUGKAN 0 1/8 12/03/29	1'000	0	0	1'000 CHF	92.70%	927'000.00	0.03	a)
CH0511762061	0.0000 % PSHYPO 0 04/06/27 682	800	1'100	0	1'900 CHF	96.00%	1'824'000.00	0.06	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.
CH0515152467	0.1300 % SCMN VX 0.13 09/18/31	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0517825268	0.1250 % JXN 0 1/8 07/14/28 EMTN	1'220	950	0	2'170 CHF	90.65%	1'967'105.00	0.07	a)
CH0517825326	0.0650 % NAB 0.065 01/29/29 EMTN	0	60	60	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0520663581	0.0000 % UBS 0 07/31/25 EMTN	1'380	440	0	1'820 CHF	97.59%	1'776'138.00	0.06	a)
CH0520663599	0.0000 % UBS 0 10/31/30 EMTN	1'450	100	0	1'550 CHF	89.70%	1'390'350.00	0.05	a)
CH0520663607	0.0000 % TRANS 0 02/24/32	300	830	0	1'130 CHF	87.55%	989'315.00	0.04	a)
CH0522158838	0.0375 % TPNZ 0.0375 03/16/29	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158879	0.1000 % VALIAN 0.1 05/07/31	0	1'775	0	1'775 CHF	88.80%	1'576'200.00	0.06	a)
CH0522158887	0.2000 % DBHNGR 0.2 05/20/33 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158895	0.0000 % LUCERN 0 06/25/31	560	0	0	560 CHF	91.25%	511'000.00	0.02	a)
CH0522158903	0.1000 % VALIAN 0.1 11/29/30	0	550	0	550 CHF	89.55%	492'525.00	0.02	a)
CH0522158945	0.1000 % KBAARG 0.1 12/09/30	500	0	0	500 CHF	91.15%	455'750.00	0.02	a)
CH0522158952	0.2000 % BCVAUD 0.2 12/22/33	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0522158960	0.3126 % KBFRIB 0.3126 02/02/32	400	0	0	400 CHF	90.50%	362'000.00	0.01	a)
CH0522158994	0.0100 % KBBL 0.01 07/28/26	700	550	0	1'250 CHF	96.65%	1'208'125.00	0.04	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	0	500	0	500 CHF	102.30%	511'500.00	0.02	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	0	1'600	0	1'600 CHF	100.75%	1'612'000.00	0.06	a)
CH0522690707	0.1250 % BBVASM 0 1/8 08/27/26	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158371	0.1000 % ZURNVX 0.1 08/27/32 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158397	0.0000 % PSHYPO 0 02/25/28 683	4'410	230	0	4'640 CHF	94.84%	4'400'576.00	0.16	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	400	50	0	450 CHF	73.18%	329'310.00	0.01	a)
CH0525158421	0.2031 % AMPAU 0.2031 06/03/24 EMTN	0	130	130	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158447	0.7000 % SYN NVX 0.7 12/09/26	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158454	0.0000 % SWIAL 2020-1 A	1'060	0	1'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0525158462	0.1250 % VORHYP 0 1/8 03/27/30 EMTN	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0528881169	0.0000 % PSHYPO 0 02/26/30	1'200	1'850	0	3'050 CHF	92.31%	2'815'455.00	0.10	a)
CH0528881193	0.2975 % BNS 0.2975 04/03/28 EMTN	0	500	0	500 CHF	95.15%	475'750.00	0.02	a)
CH0528881201	0.2500 % GENEVA 0 1/4 02/15/28	200	500	0	700 CHF	96.00%	672'000.00	0.02	a)
CH0536892588	0.9500 % SGSNVX 0.95 11/06/26	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892620	1.0000 % FIRMEN 1 12/19/23	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892703	0.1250 % PFZENT 0 1/8 04/23/32 519	2'630	2'500	0	5'130 CHF	90.22%	4'628'286.00	0.16	a)
CH0536892711	0.2000 % PFZENT 0.2 05/22/42 520	1'220	2'025	0	3'245 CHF	79.75%	2'587'887.50	0.09	a)
CH0536892737	0.0000 % ZURICH 0 06/23/28	1'170	800	0	1'970 CHF	95.10%	1'873'470.00	0.07	a)
CH0536892745	0.1000 % ZURICH 0.1 06/23/45	1'980	500	0	2'480 CHF	77.70%	1'926'960.00	0.07	a)
CH0536892752	0.1000 % PFZENT 0.1 06/12/30 521	150	1'300	0	1'450 CHF	92.51%	1'341'395.00	0.05	a)
CH0536892760	0.2500 % PFZENT 0 1/4 06/12/40 522	250	250	0	500 CHF	82.23%	411'150.00	0.01	a)
CH0536892828	1.4500 % AKEB 1.45 07/23/27	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536892901	0.2000 % PFZENT 0.2 07/13/35 523	4'720	140	0	4'860 CHF	86.95%	4'225'770.00	0.15	a)
CH0536893198	0.0000 % PFZENT 0 06/21/28 524	2'660	1'200	0	3'860 CHF	94.47%	3'646'542.00	0.13	a)
CH0536893214	0.1250 % PFZENT 0 1/8 09/03/35 525	1'000	1'990	0	2'990 CHF	86.05%	2'572'895.00	0.09	a)
CH0536893230	0.9500 % GEOFIS 0.95 03/25/30	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893255	0.3000 % LLBSW 0.3 09/24/30	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893271	0.7000 % ALLNSW 0.7 09/22/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893370	0.6250 % SWICA 2020-1 A	940	0	940	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0536893412	0.0000 % PFZENT 0 07/19/30 526	2'550	0	0	2'550 CHF	91.80%	2'340'900.00	0.08	a)
CH0536893420	0.0500 % PFZENT 0.05 10/06/43 527	0	500	0	500 CHF	75.96%	379'800.00	0.01	a)
CH0536893511	0.1000 % EGW 0.1 11/02/38 64	780	0	780	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0537261924	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/13/27 686	1'400	1'000	0	2'400 CHF	95.98%	2'303'520.00	0.08	a)
CH0537261932	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/22/40 687	700	0	0	700 CHF	85.72%	600'040.00	0.02	a)
CH0538763506	0.0960 % BMO 0.096 12/22/23	1'280	0	1'280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763514	0.8750 % KOROIL 0 7/8 04/21/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0538763548	0.1250 % EUROF 0 1/8 04/28/27	700	450	0	1'150 CHF	96.35%	1'108'025.00	0.04	a)
CH0539032927	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/07/28 688	2'000	1'120	0	3'120 CHF	95.03%	2'964'936.00	0.11	a)
CH0539032950	0.8750 % ADENVX 0 7/8 11/27/25 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0540633044	0.4450 % KDB 0.445 05/08/25 EMTN	1'010	875	0	1'885 CHF	98.53%	1'857'290.50	0.07	a)
CH0543827171	0.1500 % JURA 0.15 05/22/30	1'150	0	0	1'150 CHF	93.45%	1'074'675.00	0.04	a)
CH0543827205	1.2500 % NANTDR 1 1/4 06/25/27	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545754688	0.1250 % KBBS 0 1/8 09/10/32	300	350	0	650 CHF	89.15%	579'475.00	0.02	a)
CH0545766518	0.7500 % WFC 0 3/4 05/27/25 EMTN	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766526	1.1250 % WFC 1 1/8 05/26/28 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0545766534	0.1250 % NDAFH 0 1/8 06/02/26 EMTN	0	40	40	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.
CH0545766542	0.2000 % NADB 0.2 11/28/28	780	500	0	1'280 CHF	94.35%	1'207'680.00	0.04	a)
CH0545766559	0.5500 % NADB 0.55 05/27/33	700	0	0	700 CHF	91.50%	640'500.00	0.02	a)
CH0545766575	0.6250 % SWICC 2020-1 A	200	1'000	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243235	0.0500 % GENEVA 0.05 11/15/29	770	1'500	0	2'270 CHF	93.50%	2'122'450.00	0.08	a)
CH0547243243	0.2500 % GENEVA 0 1/4 06/15/40	1'450	1'700	0	3'150 CHF	82.60%	2'601'900.00	0.09	a)
CH0547243268	0.5000 % SOONVX 0 1/2 10/06/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0547243276	0.7500 % SOONVX 0 3/4 10/06/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550103060	0.1925 % KOLAHO 0.1925 06/15/25 EMTN	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413345	0.2270 % SNCF 0.227 06/18/30 EMTN	1'570	1'000	1'570	1'000 CHF	92.95%	929'500.00	0.03	a)
CH0550413352	0.0000 % UBS 0 12/17/24 EMTN	390	50	440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0550413360	0.2500 % UBS 0 1/4 06/16/28 EMTN	1'500	2'080	0	3'580 CHF	94.20%	3'372'360.00	0.12	a)
CH0550413378	0.3500 % LAUSAN 0.35 07/06/32	300	530	0	830 CHF	91.45%	759'035.00	0.03	a)
CH0550413386	0.6000 % LAUSAN 0.6 07/06/50	200	30	0	230 CHF	79.85%	183'655.00	0.01	a)
CH0550413428	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 10/06/42 689	1'640	0	0	1'640 CHF	80.02%	1'312'328.00	0.05	a)
CH0551990705	0.3500 % NEUNBG 0.35 07/14/50	390	90	0	480 CHF	76.00%	364'800.00	0.01	a)
CH0553331809	1.0500 % FERHOL 1.05 07/09/25	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331817	0.2500 % BALHOL 0 1/4 12/16/26	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0553331833	0.0500 % RHBSZS 0.05 08/03/50	320	20	0	340 CHF	72.35%	245'990.00	0.01	a)
CH0553331858	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/02/30 690	3'390	2'000	0	5'390 CHF	92.50%	4'985'750.00	0.18	a)
CH0553331866	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/41 691	1'950	90	0	2'040 CHF	81.65%	1'665'660.00	0.06	a)
CH0553331882	0.7000 % CAF 0.7 09/04/25 EMTN	2'000	0	0	2'000 CHF	98.20%	1'964'000.00	0.07	a)
CH0553331890	0.9300 % KKGDSW 0.93 09/30/27	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0554992070	0.2625 % KOROIL 0.2625 07/30/27 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778310	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35	6'730	5'870	0	12'600 CHF	94.18%	11'866'680.00	0.42	a)
CH0557778799	0.2500 % SWISS 0 1/4 06/23/35 MAY	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778807	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 MAY	0	3'200	3'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778815	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43	0	9'150	0	9'150 CHF	108.04%	9'885'660.00	0.35	a)
CH0557778823	0.0000 % SWISS 0 06/22/29 JULY	0	1'350	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778831	0.0000 % SWISS 0 06/26/34 JULY	0	1'650	1'650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778849	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 SEP	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778856	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 SEP	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778864	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/27/30 OCT	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778872	2.5000 % SWISS 2 1/2 03/08/36 OCT	0	1'350	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778880	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/30/58 OCT	0	2'500	2'500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778906	0.0000 % SWISS 0 07/24/39 NOV	0	1'450	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778914	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/28/43 DEC	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778922	1.5000 % SWISS 1 1/2 10/26/38 JAN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0557778930	0.5000 % SWISS 0 1/2 05/24/55 JAN	0	3'550	3'550	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923837	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 09/18/28 EMTN	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923852	0.2500 % BHH 0 1/4 09/11/28 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0561923878	0.0000 % ZURCTY 0 10/26/60	520	0	0	520 CHF	64.15%	333'580.00	0.01	a)
CH0564642046	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/17/40 692	2'000	970	0	2'970 CHF	80.19%	2'381'643.00	0.08	a)
CH0564642053	0.0700 % ACANXB 0.07 09/18/29	750	0	0	750 CHF	91.35%	685'125.00	0.02	a)
CH0564642061	0.3500 % LONNVX 0.35 09/22/26	0	320	320	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642079	0.0100 % LISNSW 0.01 10/06/28	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642087	0.2500 % LISNSW 0 1/4 10/06/32	0	1'250	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0564642095	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 09/11/29 EMTN	1'400	1'550	0	2'950 CHF	92.00%	2'714'000.00	0.10	a)
CH0568056219	0.1400 % STGALL 0.14 09/16/44	480	0	0	480 CHF	76.85%	368'880.00	0.01	a)
CH0569237651	0.0300 % GENEVA 0.03 06/28/30	1'030	100	0	1'130 CHF	92.70%	1'047'510.00	0.04	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	970	150	0	1'120 CHF	87.40%	978'880.00	0.03	a)
CH0569237677	0.1250 % MET 0 1/8 09/25/28 EMTN	1'010	485	0	1'495 CHF	93.40%	1'396'330.00	0.05	a)
CH0570347341	0.1000 % ZUGKAN 0.1 10/14/31 0	640	140	0	780 CHF	89.95%	701'610.00	0.02	a)
CH0570576113	0.8750 % NANTDR 0 7/8 05/23/29	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576121	0.0500 % ZKB 0.05 11/04/32 148	1'030	0	0	1'030 CHF	88.00%	906'400.00	0.03	a)
CH0570576154	0.0000 % PFZENT 0 03/15/30 528	3'500	2'750	0	6'250 CHF	92.25%	5'765'625.00	0.20	a)
CH0570576279	0.1250 % SWISSG 0 1/8 06/30/36	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0570576303	0.6000 % LAUSAN 0.6 11/30/56	190	50	0	240 CHF	78.05%	187'320.00	0.01	a)
CH0572326988	0.0000 % PSHYPO 0 08/12/25 693	0	500	0	500 CHF	98.01%	490'050.00	0.02	a)
CH0572327002	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 10/14/33 694	1'550	300	0	1'850 CHF	88.22%	1'632'070.00	0.06	a)
CH0572327028	0.8500 % ATH 0.85 10/14/25 EMTN	1'130	1'000	1'130	1'000 CHF	97.95%	979'500.00	0.03	a)
CH0572327036	0.1500 % GIVNVX 0.15 11/10/28	0	10	10	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.
CH0572899257	0.5000 % RAIFFS 0 1/2 11/11/28	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017014	0.6250 % SWMOB 2020-2 A	440	0	440	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0575017071	0.0000 % PSHYPO 0 10/26/29 695	2'890	1'060	0	3'950 CHF	92.77%	3'664'415.00	0.13	a)
CH0575017089	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/19/32 696	3'090	600	0	3'690 CHF	89.46%	3'301'074.00	0.12	a)
CH0576005877	0.2300 % LAUSAN 0.23 11/01/60	560	0	0	560 CHF	65.60%	367'360.00	0.01	a)
CH0577734301	0.0000 % KBSCHW 0 11/13/30	470	200	0	670 CHF	90.60%	607'020.00	0.02	a)
CH0579132918	0.1500 % LUGANO 0.15 11/28/70	470	400	0	870 CHF	53.95%	469'365.00	0.02	a)
CH0581947733	0.6500 % SPSNSW 0.65 12/18/29	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0581947790	0.5000 % ATH 0 1/2 01/15/27 EMTN	870	2'450	2'020	1'300 CHF	95.10%	1'236'300.00	0.04	a)
CH0581947816	0.3750 % SPSNSW 0 3/8 02/11/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0589030946	0.0000 % ZKB 0 01/21/33 149	1'870	2'895	0	4'765 CHF	87.30%	4'159'845.00	0.15	a)
CH0589031019	0.0000 % PFZENT 0 02/05/29 529	2'850	1'350	0	4'200 CHF	93.69%	3'934'980.00	0.14	a)
CH0589031027	0.0000 % PFZENT 0 03/18/33 530	1'600	50	0	1'650 CHF	87.95%	1'451'175.00	0.05	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	2'330	250	0	2'580 CHF	84.05%	2'168'490.00	0.08	a)
CH0589031118	0.1000 % PFZENT 0.1 10/03/31 532	2'200	0	0	2'200 CHF	90.77%	1'996'940.00	0.07	a)
CH0589031126	0.2500 % PFZENT 0 1/4 04/21/36 533	0	730	0	730 CHF	86.60%	632'180.00	0.02	a)
CH0591979619	0.0000 % PSHYPO 0 05/20/41 697	1'350	0	0	1'350 CHF	77.41%	1'045'035.00	0.04	a)
CH0591979643	0.0000 % CDCEPS 0 06/26/28 EMTN	400	200	0	600 CHF	94.30%	565'800.00	0.02	a)
CH0591979650	0.0000 % UBS 0 01/27/27 EMTN	400	250	0	650 CHF	95.30%	619'450.00	0.02	a)
CH0591979668	0.0000 % UBS 0 01/27/33 EMTN	500	550	0	1'050 CHF	86.00%	903'000.00	0.03	a)
CH0592087230	0.0100 % KBBL 0.01 01/28/33	0	700	0	700 CHF	87.35%	611'450.00	0.02	a)
CH0593093211	0.1250 % KWOPER 0 1/8 02/21/31	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593893958	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/03/33 698	1'330	80	0	1'410 CHF	89.08%	1'256'028.00	0.04	a)
CH0593893966	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 01/24/41 699	400	450	0	850 CHF	81.43%	692'155.00	0.02	a)
CH0593893974	0.0000 % KOMMUN 0 03/03/42 EMTN	1'060	0	0	1'060 CHF	77.35%	819'910.00	0.03	a)
CH0593893982	0.0020 % NEDWBK 0.002 03/04/41 EMTN	560	0	0	560 CHF	79.75%	446'600.00	0.02	a)
CH0593893990	0.9500 % GVAERO 0.95 03/25/31	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0593894006	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/30/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0595205516	0.2000 % MUNHYP 0.2 03/03/31 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0598928718	0.3750 % UBS 0 3/8 08/24/29	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	3'370	810	0	4'180 CHF	91.67%	3'831'806.00	0.14	a)
CH1100259774	0.1250 % ACANXB 0 1/8 04/09/31	600	750	0	1'350 CHF	89.10%	1'202'850.00	0.04	a)
CH1100259782	0.1500 % MET 0.15 09/25/29 EMTN	750	0	0	750 CHF	91.65%	687'375.00	0.02	a)
CH1100259790	0.0000 % TESSIN 0 03/31/26	500	600	0	1'100 CHF	97.25%	1'069'750.00	0.04	a)
CH1100259808	0.2500 % MUNHYP 0 1/4 03/29/41 EMTN	690	500	0	1'190 CHF	81.30%	967'470.00	0.03	a)
CH1101096464	0.1000 % ZKB 0.1 03/31/31 150	1'720	950	0	2'670 CHF	90.70%	2'421'690.00	0.09	a)
CH1101096514	0.2500 % GLRNKB 0 1/4 04/13/35	0	500	0	500 CHF	85.85%	429'250.00	0.02	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	4'000	1'500	0	5'500 CHF	94.82%	5'215'100.00	0.19	a)
CH1101096530	0.1000 % PFZENT 0.1 05/25/32 535	200	2'500	0	2'700 CHF	89.91%	2'427'570.00	0.09	a)
CH1101096548	0.2000 % PFZENT 0.2 06/12/35 536	0	2'050	0	2'050 CHF	86.95%	1'782'475.00	0.06	a)
CH1101096613	0.2500 % MOBNSW 0 1/4 03/19/27	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1101096621	0.0000 % ZURICH 0 11/10/33	2'140	830	0	2'970 CHF	88.60%	2'631'420.00	0.09	a)
CH1101561525	0.2500 % HOLNSW 0 1/4 03/18/27	0	160	160	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1102417735	0.1000 % KBBL 0.1 03/18/30	0	900	0	900 CHF	92.15%	829'350.00	0.03	a)
CH1105672682	0.1250 % NYLIFE 0 1/8 07/23/30 EMTN	1'790	1'250	0	3'040 CHF	90.70%	2'757'280.00	0.10	a)
CH1105672690	0.3000 % GRANDX 0.3 08/31/28	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1105672724	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 06/20/31 701	2'630	2'115	0	4'745 CHF	91.33%	4'333'608.50	0.15	a)
CH1105672732	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 12/21/35 702	1'220	1'050	0	2'270 CHF	86.82%	1'970'814.00	0.07	a)
CH1105672740	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/24/42 703	1'890	0	0	1'890 CHF	82.38%	1'556'982.00	0.06	a)
CH1111392853	0.0000 % BERN 0 05/18/33	440	0	0	440 CHF	88.65%	390'060.00	0.01	a)
CH1111392887	0.2500 % CLIENT 0 1/4 05/19/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011510	0.0500 % ONT 0.05 05/12/33 EMTN	0	350	0	350 CHF	88.25%	308'875.00	0.01	a)
CH1112011536	0.4000 % GS 0.4 05/11/28 EMTN	0	140	140	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112011569	0.0000 % ZURCTY 0 11/25/30	780	100	0	880 CHF	91.95%	809'160.00	0.03	a)
CH1112455766	0.2500 % SCMNXX 0 1/4 05/18/33	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112455790	0.3750 % OERLSW 0 3/8 11/27/25	0	150	150	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112455808	0.8000 % OERLSW 0.8 11/27/28	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1112940601	0.0500 % NIDKKB 0.05 05/27/31	690	2'300	0	2'990 CHF	89.45%	2'674'555.00	0.10	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	1'110	1'800	0	2'910 CHF	89.00%	2'589'900.00	0.09	a)
CH1113755461	0.0500 % ZUGKAN 0.05 05/26/31	780	50	0	830 CHF	90.15%	748'245.00	0.03	a)
CH1115424686	0.3150 % BACR 0.315 06/04/27 EMTN	0	1'000	1'000	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.
CH1117896477	0.0300 % Q 0.03 06/18/31 EMTN	0	100	0	100 CHF	90.60%	90'600.00	0.00	a)
CH1118223408	0.1500 % KSGRAU 0.15 07/08/30	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	1'700	1'000	0	2'700 CHF	89.80%	2'424'600.00	0.09	a)
CH1118223499	0.3000 % KSSTGA 0.3 09/30/36	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118223507	0.1500 % EGW 0.15 09/09/41 65	750	0	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118461008	0.1175 % ASBBNK 0.1175 06/29/28 EMTN	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483663	0.3500 % SWICC 2021-1 A	620	0	620	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1118483747	0.3950 % MQGAU 0.395 07/20/28 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1121837228	0.1700 % KDB 0.17 07/22/31 GMTN	950	50	0	1'000 CHF	89.35%	893'500.00	0.03	a)
CH1121837244	0.5500 % DLR 0.55 04/16/29	0	90	90	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1122290187	0.0000 % PSHYPO 0 11/17/27 704	200	2'300	0	2'500 CHF	95.22%	2'380'500.00	0.08	a)
CH1122290211	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 04/25/42 705	1'400	0	0	1'400 CHF	80.47%	1'126'580.00	0.04	a)
CH1122290237	0.0500 % MUNHYP 0.05 08/13/36 EMTN	630	0	0	630 CHF	83.10%	523'530.00	0.02	a)
CH1125186663	0.1475 % BNP 0.1475 07/13/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1127263965	0.0500 % GENEVA 0.05 08/27/41	450	0	0	450 CHF	78.30%	352'350.00	0.01	a)
CH1127263973	0.1250 % HOLNSW 0 1/8 08/26/27	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053786	0.4100 % KKGDSW 0.41 09/21/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1129053802	0.2500 % C 0 1/4 08/30/29 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1130818813	0.0000 % RHBSZS 0 09/29/36	440	50	0	490 CHF	84.45%	413'805.00	0.01	a)
CH1131931243	0.0000 % PFZENT 0 07/25/31 538	3'470	1'000	0	4'470 CHF	90.33%	4'037'751.00	0.14	a)
CH1131931250	0.0000 % PFZENT 0 09/16/36 539	600	1'690	0	2'290 CHF	83.20%	1'905'280.00	0.07	a)
CH1131931284	0.3500 % KSBAAR 0.35 09/30/36	0	35	35	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931318	0.2000 % WASSER 0.2 09/29/33	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931326	0.1000 % ELEKTR 0.1 09/28/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1131931342	0.1500 % ZKB 0.15 10/21/31 152	450	1'125	0	1'575 CHF	90.80%	1'430'100.00	0.05	a)
CH1131931375	0.2000 % MUNHYP 0.2 10/27/31 EMTN	400	0	0	400 CHF	90.35%	361'400.00	0.01	a)
CH1131931409	0.3000 % PFZENT 0.3 10/29/36 540	1'170	100	0	1'270 CHF	86.46%	1'098'042.00	0.04	a)
CH1132966297	0.0300 % ACANXB 0.03 09/24/31	750	0	0	750 CHF	87.50%	656'250.00	0.02	a)
CH1132966321	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 08/19/31 706	1'830	150	0	1'980 CHF	91.11%	1'803'978.00	0.06	a)
CH1132966339	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/25/36 707	1'500	1'550	0	3'050 CHF	86.61%	2'641'605.00	0.09	a)
CH1132966347	0.2000 % SIXLTD 0.2 09/28/29	0	60	60	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1132966354	0.1250 % INSBER 0 1/8 09/28/29	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1134691620	0.3150 % DB 0.315 09/14/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122797	0.2500 % DBHNGR 0 1/4 10/27/31 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137122805	0.0000 % NEUNBG 0 10/29/29	440	595	0	1'035 CHF	92.80%	960'480.00	0.03	a)
CH1137122839	0.2500 % PACLIF 0 1/4 10/26/28 EMTN	1'300	530	0	1'830 CHF	92.85%	1'699'155.00	0.06	a)
CH1137407412	0.1800 % CM 0.18 04/20/29	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1137407453	0.1250 % MUNHYP 0 1/8 10/05/29 EMTN	300	0	0	300 CHF	92.50%	277'500.00	0.01	a)
CH1139995786	0.5250 % AMALEA 0.525 10/27/26	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1139995810	0.0100 % MUNHYP 0.01 11/10/26	1'300	600	0	1'900 CHF	96.20%	1'827'800.00	0.06	a)
CH1141700430	0.2500 % ZURCTY 0 1/4 11/24/51	650	0	0	650 CHF	74.85%	486'525.00	0.02	a)
CH1141700463	0.2000 % BERN 0.2 11/26/36	600	1'110	0	1'710 CHF	86.40%	1'477'440.00	0.05	a)
CH1141700521	0.0000 % AMALEA 0 02/18/25	1'075	0	0	1'075 CHF	98.30%	1'056'725.00	0.04	a)
CH1141700547	0.2000 % UBPRIV 0.2 12/15/26	0	1'200	1'200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1141944459	0.5400 % LAUSAN 0.54 11/06/62	500	50	0	550 CHF	73.25%	402'875.00	0.01	a)
CH1142754253	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/10/32 708	2'150	170	0	2'320 CHF	91.33%	2'118'856.00	0.08	a)
CH1142754329	0.4225 % BAC 0.4225 11/23/29 EMTN	0	210	210	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1142754345	0.1250 % SIXLTD 0 1/8 11/27/26 TRDL	0	510	510	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096140	0.3200 % HSBC 0.32 11/03/27 EMTN	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1145096157	0.8125 % HSBC 0.8125 11/03/31 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266161	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 11/15/28 709	575	90	0	665 CHF	94.51%	628'491.50	0.02	a)
CH1148266203	0.3325 % SOCGEN 0.3325 11/29/28 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148266252	0.3850 % BNS 0.385 02/01/29 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148267755	0.1500 % KBSCHW 0.15 11/30/29	450	700	0	1'150 CHF	92.60%	1'064'900.00	0.04	a)
CH1148308708	0.1575 % CBAAU 0.1575 12/08/31 EMTN	650	0	0	650 CHF	89.45%	581'425.00	0.02	a)
CH1148308716	0.1100 % CABEI 0.11 12/15/28 EMTN	500	1'200	0	1'700 CHF	92.10%	1'565'700.00	0.06	a)
CH1148308724	0.1250 % GIVNVX 0 1/8 06/07/27	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148308732	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 06/07/30	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1148728046	0.1000 % PFZENT 0.1 05/05/31 541	2'100	1'000	0	3'100 CHF	91.33%	2'831'230.00	0.10	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.
CH1148728111	0.2000 % ZKB 0.2 07/31/30 153	950	650	0	1'600 CHF	92.25%	1'476'000.00	0.05	a)
CH1148728178	0.3750 % PFZENT 0 3/8 11/03/32 542	1'200	120	0	1'320 CHF	91.57%	1'208'724.00	0.04	a)
CH1148728186	0.4500 % PFZENT 0.45 02/11/42 543	550	0	0	550 CHF	83.86%	461'230.00	0.02	a)
CH1148728251	0.3500 % PFZENT 0.35 08/02/27 544	1'400	250	0	1'650 CHF	96.76%	1'596'540.00	0.06	a)
CH1148728269	0.6500 % PFZENT 0.65 10/03/31 545	1'500	1'000	0	2'500 CHF	94.67%	2'366'750.00	0.08	a)
CH1148728277	0.7500 % PFZENT 0 3/4 03/02/37 546	600	0	0	600 CHF	91.44%	548'640.00	0.02	a)
CH1149985959	0.0000 % EUROF 0 12/22/31	650	250	0	900 CHF	90.20%	811'800.00	0.03	a)
CH1151526154	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/19/31 710	3'850	780	0	4'630 CHF	90.67%	4'198'021.00	0.15	a)
CH1151526170	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 02/19/29 711	550	450	0	1'000 CHF	94.24%	942'400.00	0.03	a)
CH1151526196	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 02/16/37 712	1'500	560	0	2'060 CHF	87.18%	1'795'908.00	0.06	a)
CH1151526212	0.2825 % CM 0.2825 02/03/27 EMTN	0	750	750	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1151526238	0.4500 % CAF 0.45 02/24/27 EMTN	1'900	0	0	1'900 CHF	95.95%	1'823'050.00	0.06	a)
CH1154887140	1.0000 % HOLNSW 1 01/19/32	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1158693296	0.3000 % ZUGKAN 0.3 01/31/30	600	100	0	700 CHF	93.45%	654'150.00	0.02	a)
CH1160188319	0.2925 % NAB 0.2925 02/03/28 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160188343	0.6250 % AXPOSW 0 5/8 02/04/27	0	800	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382896	0.2200 % ACANXB 0.22 07/28/28	350	150	0	500 CHF	93.80%	469'000.00	0.02	a)
CH1160382912	0.0000 % PSHYPO 0 05/26/26 713	1'050	1'600	0	2'650 CHF	97.07%	2'572'355.00	0.09	a)
CH1160382979	1.2850 % MQGAU 1.285 09/11/29 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1160382987	0.6250 % BERN 0 5/8 03/27/35	900	50	0	950 CHF	92.60%	879'700.00	0.03	a)
CH1160680166	0.4000 % MUNHYP 0.4 02/25/26 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1164800661	0.4500 % ENGAKR 0.45 03/02/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151899	0.5000 % ROSW 0 1/2 02/25/27	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151907	0.7500 % ROSW 0 3/4 02/25/31	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1166151923	0.2500 % PSHYPO 0 1/4 03/15/27 714	300	1'000	0	1'300 CHF	96.82%	1'258'660.00	0.04	a)
CH1166151949	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/10/35 715	1'250	0	0	1'250 CHF	92.57%	1'157'125.00	0.04	a)
CH1166151964	0.3500 % STAAKA 0.35 03/24/27	610	0	0	610 CHF	96.90%	591'090.00	0.02	a)
CH1166151972	0.5000 % VORHYP 0 1/2 04/07/27 EMTN	700	600	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1167134845	0.6800 % LAUSAN 0.68 03/11/58	500	40	0	540 CHF	79.45%	429'030.00	0.02	a)
CH1167887251	0.2780 % BNS 0.278 04/01/27 EMTN	1'600	200	0	1'800 CHF	96.50%	1'737'000.00	0.06	a)
CH1168499775	0.7500 % ABBNVX 0 3/4 03/25/27	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1168499817	0.7500 % GEBNVX 0 3/4 09/29/27	0	20	20	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565621	0.2500 % ZKB 0 1/4 03/28/28 154	450	1'050	0	1'500 CHF	95.40%	1'431'000.00	0.05	a)
CH1170565654	0.7500 % PFZENT 0 3/4 08/19/30 547	900	0	0	900 CHF	96.29%	866'610.00	0.03	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	650	1'000	0	1'650 CHF	95.51%	1'575'915.00	0.06	a)
CH1170565670	1.0000 % PFZENT 1 10/12/37 549	650	1'530	0	2'180 CHF	94.07%	2'050'726.00	0.07	a)
CH1170565696	0.2000 % ZKB 0.2 03/31/25 155	1'200	200	0	1'400 CHF	98.55%	1'379'700.00	0.05	a)
CH1170565712	1.1250 % ZURNVX 1 1/8 07/04/29 EMTN	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565720	1.3000 % BQNCHT 1.3 04/28/32	450	2'345	0	2'795 CHF	97.30%	2'719'535.00	0.10	a)
CH1170565738	1.2500 % EGW 1 1/4 04/25/42 66	680	0	680	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	1'850	0	0	1'850 CHF	99.05%	1'832'425.00	0.07	a)
CH1170565803	1.4000 % PFZENT 1.4 08/30/32 551	2'800	900	0	3'700 CHF	99.85%	3'694'450.00	0.13	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	1'800	0	0	1'800 CHF	99.55%	1'791'900.00	0.06	a)
CH1174335724	0.2350 % NEDWBK 0.235 04/14/27 EMTN	200	450	0	650 CHF	96.80%	629'200.00	0.02	a)
CH1174335757	0.4000 % RY 0.4 10/05/26 EMTN	1'300	0	0	1'300 CHF	97.35%	1'265'550.00	0.04	a)
CH1174335765	0.5075 % SPABOL 0.5075 04/06/27 EMTN	1'100	350	0	1'450 CHF	97.00%	1'406'500.00	0.05	a)
CH1174335781	1.0000 % PSHYPO 1 09/06/30 716	1'350	1'200	0	2'550 CHF	97.81%	2'494'155.00	0.09	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	800	200	0	1'000 CHF	93.29%	932'900.00	0.03	a)
CH1174335815	0.5450 % KBN 0.545 04/28/28 EMTN	1'000	0	0	1'000 CHF	96.90%	969'000.00	0.03	a)
CH1175016091	0.3750 % MUNHYP 0 3/8 04/07/26 EMTN	300	250	0	550 CHF	97.70%	537'350.00	0.02	a)
CH1175016109	1.7500 % ALPHSW 1 3/4 06/24/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1177791840	0.7500 % ZURCTY 0 3/4 04/25/31	900	3'425	0	4'325 CHF	96.55%	4'175'787.50	0.15	a)
CH1177791865	0.2950 % BNS 0.295 04/25/25	700	0	0	700 CHF	98.47%	689'290.00	0.02	a)
CH1177791873	0.7325 % BNS 0.7325 04/25/29	650	150	0	800 CHF	96.00%	768'000.00	0.03	a)
CH1179184416	0.8900 % CFF 0.89 04/27/29 EMTN	1'200	1'950	0	3'150 CHF	96.95%	3'053'925.00	0.11	a)
CH1179184424	0.9400 % KDB 0.94 04/28/27 GMTN	750	750	0	1'500 CHF	98.15%	1'472'250.00	0.05	a)
CH1179534933	1.0500 % SOONVX 1.05 02/19/29	0	20	20	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534958	0.9675 % CM 0.9675 04/26/29 EMTN	1'050	250	0	1'300 CHF	97.25%	1'264'250.00	0.04	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1179534982	1.3750 % NYLIFE 1 3/8 05/04/28 GMTN	800	350	0	1'150 CHF	99.00%	1'138'500.00	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1179534990	1.7500 % PACLIF 1 3/4 05/02/29 MTN	850	450	0	1'300 CHF	99.40%	1'292'200.00	0.05	a)
CH1179535013	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 718	1'600	3'300	0	4'900 CHF	99.80%	4'890'200.00	0.17	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	700	2'565	0	3'265 CHF	101.86%	3'325'729.00	0.12	a)
CH1181713640	1.3625 % RABOBK 1.3625 04/28/28 GMTN	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1182086848	1.6500 % KSAARA 1.65 05/22/37	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694722	1.8000 % HTHROW 1.8 05/27/27	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694730	1.1675 % DNBNO 1.1675 06/03/27 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1184694748	0.7800 % STAAKA 0.78 05/24/28 EMTN	400	400	0	800 CHF	97.40%	779'200.00	0.03	a)
CH1188229772	1.2000 % ZUGKAN 1.2 06/02/28	400	1'520	0	1'920 CHF	99.05%	1'901'760.00	0.07	a)
CH1189217719	1.3000 % GRKPSW 1.3 05/27/30	0	1'100	0	1'100 CHF	99.85%	1'098'350.00	0.04	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	2'150	4'050	0	6'200 CHF	100.82%	6'250'840.00	0.22	a)
CH1189217834	1.7000 % PFZENT 1.7 07/27/32 554	2'450	2'250	0	4'700 CHF	102.24%	4'805'280.00	0.17	a)
CH1189217842	1.9000 % PFZENT 1.9 07/07/42 555	1'050	1'750	0	2'800 CHF	106.76%	2'989'280.00	0.11	a)
CH1189217859	1.9000 % BERCTY 1.9 06/27/53	800	1'050	0	1'850 CHF	113.70%	2'103'450.00	0.07	a)
CH1189217867	2.1000 % DAESW 2.1 07/13/27	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189217891	1.4500 % PFZENT 1.45 04/30/30 556	1'300	0	0	1'300 CHF	100.58%	1'307'540.00	0.05	a)
CH1189217909	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 557	1'400	4'210	0	5'610 CHF	101.95%	5'719'395.00	0.20	a)
CH1189217917	1.8000 % PFZENT 1.8 05/23/36 558	1'500	1'420	0	2'920 CHF	103.80%	3'030'960.00	0.11	a)
CH1189217925	1.4000 % ZKB 1.4 07/25/29 156	700	300	0	1'000 CHF	99.95%	999'500.00	0.04	a)
CH1189217990	1.2500 % SGSNVX 1 1/4 09/05/25	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1189218006	1.7000 % SGSNVX 1.7 09/05/29	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066187	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 09/06/33 720	1'900	2'000	0	3'900 CHF	100.50%	3'919'500.00	0.14	a)
CH1191066203	1.0725 % SWICC 2022-1 A	700	0	0	700 CHF	98.25%	687'750.00	0.02	a)
CH1191066237	1.5000 % ZURCTY 1 1/2 06/24/52	1'000	465	0	1'465 CHF	104.05%	1'524'332.50	0.05	a)
CH1191066252	2.0000 % KKWLEB 2 06/15/27	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1191066278	1.5462 % CABEI 1.5462 11/30/26 EMTN	400	0	0	400 CHF	99.30%	397'200.00	0.01	a)
CH1191714711	1.6250 % GIVNVX 1 5/8 06/15/29	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1193213027	1.5000 % KTBS 1 1/2 07/21/28	900	1'000	0	1'900 CHF	101.35%	1'925'650.00	0.07	a)
CH1193213076	1.7500 % KBBS 1 3/4 09/21/29 001	400	750	0	1'150 CHF	101.85%	1'171'275.00	0.04	a)
CH1193213100	1.4000 % KTBS 1.4 11/24/27	900	150	0	1'050 CHF	100.90%	1'059'450.00	0.04	a)
CH1193213126	1.2000 % KTBS 1.2 12/22/28	400	290	0	690 CHF	100.05%	690'345.00	0.02	a)
CH1193213134	1.7500 % KBBS 1 3/4 04/04/25 002	0	750	0	750 CHF	100.22%	751'650.00	0.03	a)
CH1193213142	2.1000 % KBBS 2.1 05/03/33 003	0	1'150	0	1'150 CHF	105.35%	1'211'525.00	0.04	a)
CH1194000316	1.8100 % NDAFH 1.81 06/15/27 EMTN	0	400	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000324	1.4500 % HELNSW 1.45 06/25/26	0	500	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194000332	1.9500 % HELNSW 1.95 06/25/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355033	1.4950 % RY 1.495 07/08/25 EMTN	950	0	0	950 CHF	99.88%	948'860.00	0.03	a)
CH1194355058	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 10/18/32 721	1'700	1'600	0	3'300 CHF	105.72%	3'488'760.00	0.12	a)
CH1194355066	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 722	1'650	4'350	0	6'000 CHF	110.73%	6'643'800.00	0.24	a)
CH1194355074	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 723	800	2'440	0	3'240 CHF	119.87%	3'883'788.00	0.14	a)
CH1194355082	1.8750 % UBS 1 7/8 06/29/26 EMTN	700	350	0	1'050 CHF	100.55%	1'055'775.00	0.04	a)
CH1194355108	1.6250 % NESNVX 1 5/8 07/15/26	0	1'300	1'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355116	2.1250 % NESNVX 2 1/8 07/15/30	0	250	250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1194355124	2.5000 % NESNVX 2 1/2 07/14/34	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1195555409	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 EMTN	500	700	0	1'200 CHF	99.20%	1'190'400.00	0.04	a)
CH1196216985	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/34	360	50	0	410 CHF	106.90%	438'290.00	0.02	a)
CH1196216993	1.7125 % CM 1.7125 07/13/27 EMTN	1'000	850	0	1'850 CHF	100.65%	1'862'025.00	0.07	a)
CH1199322343	2.0000 % BLSNSW 2 07/26/47	595	0	0	595 CHF	114.05%	678'597.50	0.02	a)
CH1199322350	1.9000 % BALHOL 1.9 07/19/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1199322384	0.9194 % NWIDE 0.9194 12/17/25	650	400	0	1'050 CHF	98.85%	1'037'925.00	0.04	a)
CH1199659934	2.1500 % MET 2.15 12/07/26 EMTN	700	450	0	1'150 CHF	101.40%	1'166'100.00	0.04	a)
CH1199659942	1.8750 % RHBSZS 1 7/8 07/21/34	250	1'195	0	1'445 CHF	105.40%	1'523'030.00	0.05	a)
CH1199659959	0.7500 % PSHYPO 0 3/4 08/12/25 724	0	1'100	0	1'100 CHF	99.07%	1'089'770.00	0.04	a)
CH1199659975	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/25/38 725	1'600	800	0	2'400 CHF	105.03%	2'520'720.00	0.09	a)
CH1199660007	1.1250 % LUGANO 1 1/8 09/01/28	400	0	0	400 CHF	99.05%	396'200.00	0.01	a)
CH1202242223	1.5203 % NWIDE 1.5203 12/17/29	900	750	0	1'650 CHF	99.95%	1'649'175.00	0.06	a)
CH1202242249	0.9675 % BHH 0.9675 08/04/26 EMTN	850	450	0	1'300 CHF	98.75%	1'283'750.00	0.05	a)
CH1204175132	0.8750 % CBAAU 0 7/8 09/02/25 EMTN	740	700	0	1'440 CHF	99.10%	1'427'040.00	0.05	a)
CH1204175140	1.2400 % CBAAU 1.24 09/02/29 EMTN	1'030	0	0	1'030 CHF	98.75%	1'017'125.00	0.04	a)
CH1204259738	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 726	1'700	2'730	0	4'430 CHF	99.76%	4'419'368.00	0.16	a)
CH1204259746	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 12/22/42 727	850	2'350	0	3'200 CHF	100.35%	3'211'200.00	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1204259761	1.0500 % GLRNKB 1.05 06/19/26	0	1'000	0	1'000 CHF	98.95%	989'500.00	0.04	a)
CH1204259779	2.0000 % AXPOSW 2 09/15/26	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259787	2.5000 % AXPOSW 2 1/2 03/15/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1204259795	1.0225 % SEK 1.0225 09/21/27 EMTN	650	450	0	1'100 CHF	98.85%	1'087'350.00	0.04	a)
CH1204259803	1.6250 % TESSIN 1 5/8 09/19/30	700	500	0	1'200 CHF	102.15%	1'225'800.00	0.04	a)
CH1204259811	1.9500 % DBHNGR 1.95 09/21/32 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367398	1.7500 % GEBNVX 1 3/4 09/14/29	0	315	315	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367406	1.5000 % PFZENT 1 1/2 05/22/29 559	0	1'600	0	1'600 CHF	100.81%	1'612'960.00	0.06	a)
CH1206367422	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 560	1'600	1'600	0	3'200 CHF	104.70%	3'350'400.00	0.12	a)
CH1206367471	2.5500 % GROUPE 2.55 09/30/32	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367521	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 561	600	1'500	0	2'100 CHF	104.51%	2'194'710.00	0.08	a)
CH1206367539	2.2000 % PFZENT 2.2 10/04/34 562	1'250	0	0	1'250 CHF	107.35%	1'341'875.00	0.05	a)
CH1206367562	2.2500 % AMALEA 2 1/4 02/06/26 221	400	250	0	650 CHF	100.80%	655'200.00	0.02	a)
CH1206367570	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 563	550	1'700	0	2'250 CHF	100.54%	2'262'150.00	0.08	a)
CH1206367588	2.1250 % PFZENT 2 1/8 08/19/30 564	1'400	1'600	0	3'000 CHF	104.75%	3'142'500.00	0.11	a)
CH1206367596	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 565	850	2'410	0	3'260 CHF	110.81%	3'612'406.00	0.13	a)
CH1206367604	2.1000 % WURTH 2.1 11/16/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367620	2.1250 % EGW 2 1/8 11/24/42 67	300	0	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367638	1.8500 % ZKB 1.85 11/29/27 157	600	1'300	0	1'900 CHF	101.55%	1'929'450.00	0.07	a)
CH1206367661	2.2000 % BALHOL 2.2 05/30/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1206367679	1.4500 % ZURICH 1.45 12/14/29	1'550	1'140	0	2'690 CHF	101.65%	2'734'385.00	0.10	a)
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	600	0	0	600 CHF	98.80%	592'800.00	0.02	a)
CH1210198128	2.0800 % CAF 2.08 08/31/28 EMTN	900	0	0	900 CHF	100.50%	904'500.00	0.03	a)
CH1210198144	2.7170 % CLNVX 2.717 09/24/27	0	60	60	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713156	1.6075 % ACANXB 1.6075 09/23/27	400	200	0	600 CHF	99.90%	599'400.00	0.02	a)
CH1211713164	1.9700 % ACANXB 1.97 09/23/32	300	0	0	300 CHF	101.85%	305'550.00	0.01	a)
CH1211713172	1.4500 % NEUNBG 1.45 09/23/30	650	780	0	1'430 CHF	101.50%	1'451'450.00	0.05	a)
CH1211713206	1.3500 % LBANK 1.35 09/30/27 EMTN	800	200	0	1'000 CHF	100.55%	1'005'500.00	0.04	a)
CH1211713214	2.0375 % TRANS 2.0375 09/29/34	400	780	0	1'180 CHF	102.95%	1'214'810.00	0.04	a)
CH1211713222	1.5000 % ROSW 1 1/2 06/23/26	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1211713230	2.0000 % ROSW 2 09/23/32	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1212189133	1.6800 % STAAKA 1.68 09/20/32 EMTN	400	0	0	400 CHF	101.35%	405'400.00	0.01	a)
CH1212189166	1.4800 % WSTP 1.48 09/21/26	600	400	0	1'000 CHF	100.20%	1'002'000.00	0.04	a)
CH1213243871	1.8025 % WSTP 1.8025 09/21/29	600	700	0	1'300 CHF	101.40%	1'318'200.00	0.05	a)
CH1214797131	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 728	1'950	2'810	0	4'760 CHF	105.20%	5'007'520.00	0.18	a)
CH1214797164	2.2500 % CRNBK 2 1/4 10/11/27 EMTN	300	780	0	1'080 CHF	101.80%	1'099'440.00	0.04	a)
CH1214797180	2.1000 % ABBNVX 2.1 10/03/25	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797206	2.3775 % ADENVX 2.3775 11/17/27 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1214797214	2.9550 % BAWAG 2.955 11/29/27 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1216400056	2.1550 % KHFC 2.155 10/14/25	650	0	0	650 CHF	100.75%	654'875.00	0.02	a)
CH1216400064	2.4650 % KHFC 2.465 10/14/27	750	0	0	750 CHF	102.75%	770'625.00	0.03	a)
CH1216400080	1.6600 % AUCCCN 1.66 10/18/27 EMTN	300	750	0	1'050 CHF	100.85%	1'058'925.00	0.04	a)
CH1216740667	2.1250 % KBBL 2 1/8 10/04/52	0	345	0	345 CHF	115.70%	399'165.00	0.01	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	1'200	240	0	1'440 CHF	102.30%	1'473'120.00	0.05	a)
CH1217066591	2.0000 % KBBL 2 02/23/34	1'050	1'200	0	2'250 CHF	104.25%	2'345'625.00	0.08	a)
CH1217066609	1.8750 % KBBL 1 7/8 03/28/25	0	1'300	0	1'300 CHF	100.30%	1'303'900.00	0.05	a)
CH1218301955	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 730	650	2'000	0	2'650 CHF	105.60%	2'798'400.00	0.10	a)
CH1218301963	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 09/25/37 731	2'350	1'050	0	3'400 CHF	109.49%	3'722'660.00	0.13	a)
CH1218301971	2.6250 % SOCGEN 2 5/8 10/14/26 EMTN	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1221150464	2.0050 % AUCCCN 2.005 10/18/32 EMTN	300	1'030	0	1'330 CHF	104.00%	1'383'200.00	0.05	a)
CH1221150480	1.9575 % NACN 1.9575 11/03/27 EMTN	1'100	750	0	1'850 CHF	101.80%	1'883'300.00	0.07	a)
CH1223336004	2.1480 % LAUSAN 2.148 11/03/2072	260	20	0	280 CHF	124.05%	347'340.00	0.01	a)
CH1223665055	2.0000 % TESSIN 2 11/20/37	515	720	0	1'235 CHF	107.05%	1'322'067.50	0.05	a)
CH1226543861	1.9000 % SIKASW 1.9 11/28/25	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1226543879	2.3500 % SIKASW 2.35 11/28/28	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1227937732	1.6250 % KOMMUN 1 5/8 06/12/30 EMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	102.35%	2'763'450.00	0.10	a)
CH1228837873	3.0000 % NEUNBG 3 12/21/26 MTN	550	400	0	950 CHF	104.60%	993'700.00	0.04	a)
CH1228837881	1.5150 % DBSSP 1.515 12/12/25	750	500	0	1'250 CHF	99.85%	1'248'125.00	0.04	a)
CH1228837907	2.7700 % BBVASM 2.77 11/28/28 GMTN	0	100	100	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.
CH1230759503	1.9500 % SOONVX 1.95 12/12/30	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1230759537	1.2750 % KBN 1.275 12/22/27 EMTN	400	1'100	0	1'500 CHF	100.00%	1'500'000.00	0.05 a)	
CH1231094363	1.9600 % BAWAG 1.96 05/26/31 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	101.90%	1'528'500.00	0.05 a)	
CH1231094371	1.7000 % BERCTY 1.7 01/24/33	350	50	0	400 CHF	103.25%	413'000.00	0.01 a)	
CH1231312674	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 11/28/29 EMTN	600	800	0	1'400 CHF	102.15%	1'430'100.00	0.05 a)	
CH1231312682	2.1375 % CABEL 2.1375 12/13/27 EMTN	400	0	0	400 CHF	100.75%	403'000.00	0.01 a)	
CH1232106992	2.4300 % SWMOB 2022-1 A	750	0	0	750 CHF	100.00%	750'000.00	0.03 a)	
CH1232107024	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/19/27 566	495	0	0	495 CHF	100.51%	497'524.50	0.02 a)	
CH1232107032	1.7000 % PFZENT 1.7 12/02/30 567	1'150	1'000	0	2'150 CHF	102.15%	2'196'225.00	0.08 a)	
CH1232107040	1.8000 % PFZENT 1.8 12/12/34 568	1'550	500	0	2'050 CHF	103.34%	2'118'470.00	0.08 a)	
CH1232107073	1.5500 % RHBSZS 1.55 12/14/38	300	200	0	500 CHF	103.05%	515'250.00	0.02 a)	
CH1232107149	1.6250 % ZURCTY 1 5/8 01/26/37	700	20	0	720 CHF	102.40%	737'280.00	0.03 a)	
CH1232107172	1.6250 % LUGANO 1 5/8 02/01/29	350	200	0	550 CHF	101.40%	557'700.00	0.02 a)	
CH1233294920	1.8000 % KBSCHW 1.8 12/15/31	500	500	0	1'000 CHF	102.25%	1'022'500.00	0.04 a)	
CH1233900005	1.8750 % MUNHYP 1 7/8 05/07/30 EMTN	550	950	0	1'500 CHF	102.25%	1'533'750.00	0.05 a)	
CH1236363409	1.7575 % NWIDE 1.7575 01/23/26	1'100	0	0	1'100 CHF	100.25%	1'102'750.00	0.04 a)	
CH1236363417	2.0125 % NWIDE 2.0125 01/23/30	550	1'200	0	1'750 CHF	102.70%	1'797'250.00	0.06 a)	
CH1239464550	1.9000 % PFZENT 1.9 02/12/38 569	800	850	0	1'650 CHF	105.50%	1'740'750.00	0.06 a)	
CH1239464568	2.1000 % LAUSAN 2.1 02/17/48	450	400	0	850 CHF	111.00%	943'500.00	0.03 a)	
CH1239464576	2.4925 % SWMOB 2023-1 A	530	0	0	530 CHF	100.05%	530'265.00	0.02 a)	
CH1239464618	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 MAR	850	0	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464626	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 MAR	1'250	0	1'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464634	2.1250 % PFZENT 2 1/8 09/21/38 570	785	2'200	0	2'985 CHF	108.47%	3'237'829.50	0.12 a)	
CH1239464659	1.9500 % EGW 1.95 03/20/43 68	800	0	800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464667	2.2000 % WINCTY 2.2 03/27/58	0	650	0	650 CHF	120.95%	786'175.00	0.03 a)	
CH1239464691	3.0000 % ALLNSW 3 04/19/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464709	2.7500 % ZKB 2 3/4 04/19/28	0	1'700	1'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464725	2.0000 % PFZENT 2 12/17/29 571	0	2'450	0	2'450 CHF	103.60%	2'538'200.00	0.09 a)	
CH1239464733	2.0500 % PFZENT 2.05 05/25/32 572	0	2'905	0	2'905 CHF	104.96%	3'049'088.00	0.11 a)	
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	3'860	0	3'860 CHF	106.60%	4'114'760.00	0.15 a)	
CH1239464774	2.6250 % MOBNSW 2 5/8 05/25/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1239464790	2.0500 % BQTESS 2.05 05/24/30	0	2'365	0	2'365 CHF	102.95%	2'434'767.50	0.09 a)	
CH1239494979	1.7125 % SEK 1.7125 01/17/30 EMTN	550	750	0	1'300 CHF	101.85%	1'324'050.00	0.05 a)	
CH1239494987	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 732	700	3'650	0	4'350 CHF	102.02%	4'437'870.00	0.16 a)	
CH1239494995	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/14/33 733	1'700	1'670	0	3'370 CHF	103.75%	3'496'375.00	0.12 a)	
CH1239495059	1.9100 % ACANXB 1.91 01/25/30	500	1'300	0	1'800 CHF	101.45%	1'826'100.00	0.06 a)	
CH1239495067	1.4750 % RY 1.475 01/30/26 EMTN	650	150	0	800 CHF	99.85%	798'800.00	0.03 a)	
CH1242301302	1.7350 % CCDJ 1.735 01/31/28	1'100	650	0	1'750 CHF	100.85%	1'764'875.00	0.06 a)	
CH1243018798	1.5850 % BAWAG 1.585 12/16/26 EMTN	500	200	0	700 CHF	99.50%	696'500.00	0.02 a)	
CH1243651911	1.7150 % NAB 1.715 02/03/33 EMTN	900	400	0	1'300 CHF	101.35%	1'317'550.00	0.05 a)	
CH1243651945	2.7500 % KWLII 2 3/4 03/01/30	0	270	270	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243651952	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 01/15/31 734	1'450	500	0	1'950 CHF	103.25%	2'013'375.00	0.07 a)	
CH1243651986	1.2500 % MUNHYP 1 1/4 06/30/27 MAR	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1243933574	1.8150 % KHFC 1.815 02/10/26	600	450	0	1'050 CHF	100.25%	1'052'625.00	0.04 a)	
CH1243933582	1.8925 % KHFC 1.8925 02/10/28	300	250	0	550 CHF	100.80%	554'400.00	0.02 a)	
CH1243933590	2.4275 % CAF 2.4275 02/15/30 EMTN	700	0	0	700 CHF	101.95%	713'650.00	0.03 a)	
CH1244319450	3.6450 % DB 3.645 01/27/29 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321779	1.6250 % KUNTA 1 5/8 06/16/28 EMTN	0	1'450	0	1'450 CHF	101.65%	1'473'925.00	0.05 a)	
CH1244321787	2.2500 % ENBW 2 1/4 06/15/26 EMTN	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321795	2.6250 % ENBW 2 5/8 06/15/29 EMTN	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1244321803	1.5000 % NIB 1 1/2 06/29/28	0	1'200	0	1'200 CHF	101.40%	1'216'800.00	0.04 a)	
CH1249151049	1.7500 % CDCEPS 1 3/4 02/24/31 EMTN	400	800	0	1'200 CHF	102.15%	1'225'800.00	0.04 a)	
CH1249416020	1.9925 % STAAKA 1.9925 03/14/33 EMTN	1'000	1'250	0	2'250 CHF	103.85%	2'336'625.00	0.08 a)	
CH1249416038	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/26 735	0	1'300	0	1'300 CHF	101.78%	1'323'140.00	0.05 a)	
CH1249416046	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 11/15/30 736	0	2'600	0	2'600 CHF	104.80%	2'724'800.00	0.10 a)	
CH1249416053	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 09/17/35 737	0	3'500	0	3'500 CHF	107.00%	3'745'000.00	0.13 a)	
CH1249416079	2.2500 % GEBNVX 2 1/4 09/26/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1249416087	2.3000 % GEBNVX 2.3 09/27/32	0	70	70	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1251030107	1.9030 % CFF 1.903 06/16/28 EMTN	1'300	500	0	1'800 CHF	101.65%	1'829'700.00	0.07 a)	
CH1251998220	2.3500 % GRANDX 2.35 06/06/30	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456078	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/26	0	100	100	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.
CH1253456086	2.2500 % SIKASW 2 1/4 04/13/29	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1253456102	2.0850 % RY 2.085 03/31/28 EMTN	0	2'250	0	2'250 CHF	102.25%	2'300'625.00	0.08	a)
CH1255924396	2.0000 % ENGAKR 2 04/11/30	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924404	2.7000 % FERHOL 2.7 04/21/27	0	80	80	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924412	3.2500 % FERHOL 3 1/4 04/21/31	0	75	75	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1255924420	2.0000 % PSHYPO 2 03/03/33 738	0	3'050	0	3'050 CHF	104.75%	3'194'875.00	0.11	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	4'625	0	4'625 CHF	106.67%	4'933'487.50	0.18	a)
CH1255924461	2.6500 % MASSMU 2.65 05/03/28 EMTN	0	1'550	0	1'550 CHF	103.85%	1'609'675.00	0.06	a)
CH1255924487	2.9775 % ALNOW 2023-1 A	0	2'350	0	2'350 CHF	101.15%	2'377'025.00	0.08	a)
CH1256367165	2.0525 % BAWAG 2.0525 04/14/28 EMTN	0	1'150	0	1'150 CHF	101.25%	1'164'375.00	0.04	a)
CH1256367173	1.7500 % TESSIN 1 3/4 04/21/31	0	900	0	900 CHF	102.85%	925'650.00	0.03	a)
CH1256367181	1.7925 % BNG 1.7925 04/24/28 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	102.05%	1'020'500.00	0.04	a)
CH1256367199	2.3500 % BALHOL 2.35 05/02/33	0	60	60	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1261608892	2.0375 % BMO 2.0375 04/27/28	0	2'300	0	2'300 CHF	102.15%	2'349'450.00	0.08	a)
CH1261608918	2.0425 % BNS 2.0425 05/04/26 EMTN	0	2'000	0	2'000 CHF	101.10%	2'022'000.00	0.07	a)
CH1261608926	2.1425 % BNS 2.1425 05/03/30 EMTN	0	2'550	0	2'550 CHF	103.45%	2'637'975.00	0.09	a)
CH1264414330	3.5000 % RENAUL 3 1/2 05/10/28 EMTN	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264414348	2.1300 % TOYOTA 2.13 06/15/27 EMTN	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264823431	2.0400 % Q 2.04 05/09/33 MTN	0	660	0	660 CHF	105.10%	693'660.00	0.02	a)
CH1264823506	1.6875 % BNG 1.6875 05/19/30 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	102.55%	2'871'400.00	0.10	a)
CH1264887352	2.6250 % PSHYPO 2 5/8 02/14/31 MAY	0	1'800	1'800	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887360	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 MAY	0	695	695	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887378	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 07/05/52 MAY	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887386	2.6500 % EFIAGC 2.65 06/06/28	0	80	80	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1264887394	2.9150 % SWICC 2023-1 A	0	650	0	650 CHF	101.20%	657'800.00	0.02	a)
CH1265890660	1.4500 % BERN 1.45 10/31/30	0	1'300	0	1'300 CHF	101.20%	1'315'600.00	0.05	a)
CH1265890678	1.3000 % KTBS 1.3 12/01/27	0	550	0	550 CHF	100.60%	553'300.00	0.02	a)
CH1265890736	1.5000 % WINCTY 1 1/2 02/23/54	0	1'150	0	1'150 CHF	101.95%	1'172'425.00	0.04	a)
CH1266477004	2.3550 % LAUSAN 2.355 05/25/2074	0	460	0	460 CHF	132.85%	611'110.00	0.02	a)
CH1266847073	2.5500 % KSBAAR 2.55 06/21/38	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847107	1.7000 % PFZENT 1.7 07/24/28 574	0	560	0	560 CHF	101.54%	568'624.00	0.02	a)
CH1266847115	1.6500 % PFZENT 1.65 12/21/32 JUN	0	1'060	1'060	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847123	2.3500 % PFZENT 2.35 11/17/37 JUN	0	220	220	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847172	2.4000 % KEBAG 2.4 07/19/38	0	625	625	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847206	1.6250 % PFZENT 1 5/8 04/07/26 JUL	0	850	850	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1266847214	1.8500 % PFZENT 1.85 05/05/31 575	0	3'200	0	3'200 CHF	103.35%	3'307'200.00	0.12	a)
CH1266847222	1.8500 % PFZENT 1.85 07/19/38 576	0	3'050	0	3'050 CHF	105.10%	3'205'550.00	0.11	a)
CH1266847230	1.6000 % KUNTA 1.6 08/04/26	0	850	0	850 CHF	100.85%	857'225.00	0.03	a)
CH1266847263	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 577	0	2'350	0	2'350 CHF	102.41%	2'406'635.00	0.09	a)
CH1266847271	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 578	0	4'100	0	4'100 CHF	103.62%	4'248'420.00	0.15	a)
CH1266847289	1.8500 % PFZENT 1.85 11/26/38 579	0	2'650	0	2'650 CHF	104.87%	2'779'055.00	0.10	a)
CH1267329279	2.1000 % BCVAUD 2.1 06/07/32	0	280	280	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1268922189	1.8250 % ACACB 1.825 05/26/28 EMTN	0	1'850	0	1'850 CHF	101.65%	1'880'525.00	0.07	a)
CH1268922205	2.8750 % OERLSW 2 7/8 06/02/26	0	100	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1268922213	3.2500 % OERLSW 3 1/4 10/02/29	0	300	300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1270609485	1.8500 % VALIAN 1.85 05/31/28	0	2'200	0	2'200 CHF	100.70%	2'215'400.00	0.08	a)
CH1271007937	2.0500 % CRNBK 2.05 09/26/28	0	390	0	390 CHF	101.20%	394'680.00	0.01	a)
CH1271360385	2.0125 % WSTP 2.0125 06/13/30	0	1'950	0	1'950 CHF	102.95%	2'007'525.00	0.07	a)
CH1271360401	2.7725 % SWEDA 2.7725 06/13/28 EMTN	0	600	600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1271360419	1.8425 % STAAKA 1.8425 06/15/35 EMTN	0	1'050	0	1'050 CHF	102.60%	1'077'300.00	0.04	a)
CH1271360427	1.7500 % MUNHYP 1 3/4 06/23/28 EMTN	0	350	0	350 CHF	101.35%	354'725.00	0.01	a)
CH1271360567	1.6250 % COE 1 5/8 06/30/29 EMTN	0	1'850	0	1'850 CHF	102.35%	1'893'475.00	0.07	a)
CH1271360583	1.8100 % KBN 1.81 07/10/30 EMTN	0	700	0	700 CHF	102.60%	718'200.00	0.03	a)
CH1271360591	1.4600 % EIB 1.46 07/18/33	0	1'000	0	1'000 CHF	102.30%	1'023'000.00	0.04	a)
CH1271360609	1.6275 % NRWK 1.6275 07/27/28 EMTN	0	1'150	0	1'150 CHF	101.85%	1'171'275.00	0.04	a)
CH1271360617	1.2125 % EBRD 1.2125 03/04/31 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	100.00%	1'100'000.00	0.04	a)
CH1273475389	1.9400 % CBAAU 1.94 06/26/30 EMTN	0	2'900	0	2'900 CHF	102.75%	2'979'750.00	0.11	a)
CH1273475397	1.8750 % NESNVX 1 7/8 06/28/29	0	110	110	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1273475413	2.1250 % NESNVX 2 1/8 06/28/38	0	310	310	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1274703110	1.8984 % ACANXB 1.8984 09/23/26	0	250	0	250 CHF	100.65%	251'625.00	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1274703128	1.9320 % ACANXB 1.932 09/23/30	0	1'150	0	1'150 CHF	101.70%	1'169'550.00	0.04	a)
CH1274703151	2.6300 % RFLBOB 2.63 06/29/28 EMTN	0	40	40	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313249	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 04/09/32 JUN	0	2'250	2'250	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313256	2.0000 % PSHYPO 2 10/04/40 740	0	4'880	0	4'880 CHF	107.63%	5'252'344.00	0.19	a)
CH1276313264	1.8750 % PSHYPO 1 7/8 06/24/50 741	0	2'800	0	2'800 CHF	109.98%	3'079'440.00	0.11	a)
CH1276313272	3.0500 % ENAG 3.05 07/04/25	0	200	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313280	3.4500 % ENAG 3.45 07/06/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1276313314	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/07/33 742	0	1'000	0	1'000 CHF	102.72%	1'027'200.00	0.04	a)
CH1276313322	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 07/09/38 743	0	1'320	0	1'320 CHF	103.60%	1'367'520.00	0.05	a)
CH1276313330	2.3500 % NANTDR 2.35 07/24/31	0	450	450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1277028440	1.9850 % SNCF 1.985 06/28/33 EMTN	0	2'800	0	2'800 CHF	104.85%	2'935'800.00	0.10	a)
CH1277240938	2.7725 % FRLBP 2.7725 07/12/27 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	103.50%	1'138'500.00	0.04	a)
CH1277240946	2.8275 % FRLBP 2.8275 07/12/30 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	105.25%	1'368'250.00	0.05	a)
CH1279261122	1.9100 % CM 1.91 07/14/28	0	1'450	0	1'450 CHF	101.60%	1'473'200.00	0.05	a)
CH1279261130	4.2425 % HESLAN 4.2425 07/25/33	0	900	0	900 CHF	104.60%	941'400.00	0.03	a)
CH1279261148	1.8375 % CFF 1.8375 07/18/30 EMTN	0	1'300	0	1'300 CHF	101.90%	1'324'700.00	0.05	a)
CH1279261155	2.2225 % KDB 2.2225 07/24/26 EMTN	0	1'200	0	1'200 CHF	101.55%	1'218'600.00	0.04	a)
CH1279261163	1.7000 % ZURCTY 1.7 07/26/44	0	1'230	0	1'230 CHF	106.20%	1'306'260.00	0.05	a)
CH1279293000	1.9500 % ZUGKAN 1.95 07/07/32	0	1'830	0	1'830 CHF	103.50%	1'894'050.00	0.07	a)
CH1280154282	2.1250 % PSHYPO 2 1/8 07/07/32 AUG	0	2'000	2'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1280154290	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/43 744	0	4'400	0	4'400 CHF	105.75%	4'653'000.00	0.17	a)
CH1280154308	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 12/23/33 745	0	1'200	0	1'200 CHF	102.72%	1'232'640.00	0.04	a)
CH1280154324	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 01/26/49 746	0	1'500	0	1'500 CHF	106.51%	1'597'650.00	0.06	a)
CH1280155040	1.7500 % KBAARG 1 3/4 07/28/33	0	700	0	700 CHF	101.95%	713'650.00	0.03	a)
CH1280994281	1.8700 % LLOYDS 1.87 08/31/27 EMTN	0	2'700	0	2'700 CHF	101.30%	2'735'100.00	0.10	a)
CH1289657095	1.8750 % VORHYP 1 7/8 09/13/30 EMTN	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222285	2.3750 % BAER 2 3/8 09/06/27	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222293	2.5000 % BAER 2 1/2 09/06/30	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222301	2.4000 % KSSTGA 2.4 09/06/33	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222319	2.5000 % KSSTGA 2 1/2 09/06/38	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222327	1.8750 % LAUSAN 1 7/8 09/14/2076	0	1'000	0	1'000 CHF	115.40%	1'154'000.00	0.04	a)
CH1290222418	1.7500 % ZURCTY 1 3/4 10/23/41	0	2'300	0	2'300 CHF	106.20%	2'442'600.00	0.09	a)
CH1290222434	2.1000 % PFZENT 2.1 07/19/30 OCT	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222442	1.8000 % PFZENT 1.8 07/22/33 580	0	1'600	0	1'600 CHF	103.16%	1'650'560.00	0.06	a)
CH1290222459	1.8500 % PFZENT 1.85 10/25/38 581	0	1'650	0	1'650 CHF	104.85%	1'730'025.00	0.06	a)
CH1290222509	1.7000 % TESSIN 1.7 10/31/33	0	1'400	0	1'400 CHF	103.30%	1'446'200.00	0.05	a)
CH1290222525	1.7000 % EGW 1.7 04/29/41 70	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290222533	2.2000 % AMALEA 2.2 11/22/27	0	1'000	0	1'000 CHF	101.55%	1'015'500.00	0.04	a)
CH1290222541	2.4000 % AMALEA 2.4 11/22/30	0	900	0	900 CHF	103.70%	933'300.00	0.03	a)
CH1290870869	2.2500 % MIGBAN 2 1/4 09/26/28	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870885	1.9700 % TD 1.97 09/18/26 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	101.20%	1'416'800.00	0.05	a)
CH1290870893	1.9450 % TD 1.945 09/18/29 EMTN	0	1'500	0	1'500 CHF	102.60%	1'539'000.00	0.05	a)
CH1290870901	2.7500 % CLNVX 2 3/4 09/22/28	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870968	2.6000 % SDZSW 2.6 11/17/31	0	80	80	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1290870992	1.5825 % SNCF 1.5825 02/07/39 EMTN	0	670	0	670 CHF	101.70%	681'390.00	0.02	a)
CH1290871024	1.5125 % RATPPP 1.5125 03/06/36 EMTN	0	800	0	800 CHF	100.47%	803'760.00	0.03	a)
CH1290975528	1.9000 % KBRFRIB 1.9 09/08/26	0	750	0	750 CHF	100.90%	756'750.00	0.03	a)
CH1290975932	1.8675 % SPABOL 1.8675 10/23/28 EMTN	0	600	0	600 CHF	101.70%	610'200.00	0.02	a)
CH1291827355	1.8300 % KBSCHW 1.83 09/21/28	0	850	0	850 CHF	101.75%	864'875.00	0.03	a)
CH1292012775	2.0100 % SANUK 2.01 09/12/26 EMTN	0	1'400	0	1'400 CHF	101.25%	1'417'500.00	0.05	a)
CH1292012783	2.0050 % SANUK 2.005 09/12/29 EMTN	0	700	0	700 CHF	102.55%	717'850.00	0.03	a)
CH1293714346	2.2500 % PGHNSW 2 1/4 09/26/28	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1293714379	2.5200 % INSBER 2.52 09/29/38	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1294486332	2.6025 % LBBW 2.6025 10/04/28 EMTN	0	1'100	0	1'100 CHF	101.70%	1'118'700.00	0.04	a)
CH1296276137	1.8100 % DANBNK 1.81 10/05/26	0	1'100	0	1'100 CHF	100.95%	1'110'450.00	0.04	a)
CH1296276145	1.8650 % DANBNK 1.865 10/04/30	0	650	0	650 CHF	102.45%	665'925.00	0.02	a)
CH1296291003	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 DEC	0	1'050	1'050	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1296291037	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 DEC	0	900	900	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300224883	2.1075 % MBGGR 2.1075 10/12/29 EMTN	0	50	50	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277717	1.8200 % UBS 1.82 10/18/26	0	1'750	0	1'750 CHF	100.65%	1'761'375.00	0.06	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.
CH1300277725	2.0350 % UBS 2.035 10/18/33	0	3'050	0	3'050 CHF	103.60%	3'159'800.00	0.11	a)
CH1300277766	2.0175 % EIBKOR 2.0175 11/14/28	0	1'300	0	1'300 CHF	101.95%	1'325'350.00	0.05	a)
CH1300277774	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 NOV	0	1'450	1'450	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277782	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 12/10/32 NOV	0	2'300	2'300	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277790	2.3750 % PSHYPO 2 3/8 05/20/37 NOV	0	650	650	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300277808	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/24/43 747	0	2'100	0	2'100 CHF	104.61%	2'196'810.00	0.08	a)
CH1300277824	1.9225 % HILTI 1.9225 11/10/31	0	30	30	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1300948796	2.5525 % CAF 2.5525 10/25/29 EMTN	0	750	0	750 CHF	102.75%	770'625.00	0.03	a)
CH1305916749	1.5600 % AUCCCN 1.56 11/30/29 EMTN	0	450	0	450 CHF	100.90%	454'050.00	0.02	a)
CH1305916814	1.4500 % ZURCTY 1.45 06/13/42	0	1'950	0	1'950 CHF	101.95%	1'988'025.00	0.07	a)
CH1305916848	2.0000 % PSHYPO 2 08/25/34 DEC	0	1'100	1'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916855	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/18/47 DEC	0	1'600	1'600	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1305916913	1.3500 % CFF 1.35 01/24/31 EMTN	0	1'000	0	1'000 CHF	99.15%	991'500.00	0.04	a)
CH1306117016	1.8000 % PFZENT 1.8 09/10/29 NOV	0	1'350	1'350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117024	1.8500 % PFZENT 1.85 09/22/33 NOV	0	1'000	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117032	1.8500 % PFZENT 1.85 04/02/37 NOV	0	350	350	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1306117057	1.6000 % GENCTY 1.6 12/06/33	0	1'350	0	1'350 CHF	101.60%	1'371'600.00	0.05	a)
CH1306117073	1.4500 % ZURICH 1.45 12/01/34	0	800	0	800 CHF	101.70%	813'600.00	0.03	a)
CH1306117107	1.3000 % PFZENT 1.3 12/27/28 582	0	250	0	250 CHF	99.84%	249'600.00	0.01	a)
CH1306117115	1.4000 % PFZENT 1.4 01/16/32 583	0	1'600	0	1'600 CHF	99.95%	1'599'200.00	0.06	a)
CH1306117123	1.4500 % PFZENT 1.45 01/18/39 584	0	650	0	650 CHF	99.65%	647'725.00	0.02	a)
CH1306117149	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/34	0	75	0	75 CHF	99.95%	74'962.50	0.00	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	1'560	0	1'560 CHF	99.75%	1'556'100.00	0.06	a)
CH1306117180	1.4500 % TESSIN 1.45 01/30/54	0	500	0	500 CHF	101.20%	506'000.00	0.02	a)
CH1310346239	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 03/15/34 748	0	2'350	0	2'350 CHF	101.65%	2'388'775.00	0.08	a)
CH1310346247	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 12/21/38 749	0	900	0	900 CHF	102.00%	918'000.00	0.03	a)
CH1310346254	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 10/09/48 JAN	0	700	700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1310346320	1.3000 % TESSIN 1.3 02/26/35	0	650	0	650 CHF	99.80%	648'700.00	0.02	a)
CH1314941407	1.7780 % KHFC 1.778 02/01/27	0	1'150	0	1'150 CHF	100.40%	1'154'600.00	0.04	a)
CH1314941415	1.8450 % KHFC 1.845 02/01/30	0	900	0	900 CHF	101.20%	910'800.00	0.03	a)
CH1319968405	1.5000 % PFZENT 1 1/2 04/02/31 585	0	1'200	0	1'200 CHF	100.78%	1'209'360.00	0.04	a)
CH1319968413	1.5500 % PFZENT 1.55 10/24/33 586	0	2'650	0	2'650 CHF	101.10%	2'679'044.00	0.10	a)
CH1319968421	1.5500 % PFZENT 1.55 04/05/39 587	0	770	0	770 CHF	101.45%	781'165.00	0.03	a)
CH1319968447	1.2000 % ZURICH 1.2 03/07/30	0	1'350	0	1'350 CHF	100.23%	1'353'105.00	0.05	a)
CH1319968462	1.4150 % LUGANO 1.415 03/07/34	0	700	0	700 CHF	100.00%	700'014.00	0.02	a)
CH1319968512	1.2500 % PFZENT 1 1/4 11/16/29 MAR	0	1'050	0	1'050 CHF	99.80%	1'047'858.00	0.04	a)
CH1319968520	1.4500 % PFZENT 1.45 11/03/32 588	0	2'400	0	2'400 CHF	100.89%	2'421'264.00	0.09	a)
CH1319968538	1.5000 % PFZENT 1 1/2 06/23/36 589	0	1'360	0	1'360 CHF	101.47%	1'379'924.00	0.05	a)
CH1321481454	1.4825 % TD 1.4825 01/30/29 EMTN	0	1'800	0	1'800 CHF	100.05%	1'800'900.00	0.06	a)
CH1321481462	1.5427 % UBS 1.5427 01/22/27	0	850	0	850 CHF	100.00%	850'000.00	0.03	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	1'200	0	1'200 CHF	100.25%	1'203'000.00	0.04	a)
CH1321481496	2.3900 % LBBW 2.39 02/08/29	0	1'100	0	1'100 CHF	100.65%	1'107'150.00	0.04	a)
CH1323274063	1.7500 % PSHYPO 1 3/4 03/22/29 FEB	0	2'100	2'100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274071	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 06/10/32 FEB	0	2'700	2'700	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1323274089	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 01/28/39 750	0	1'900	0	1'900 CHF	103.24%	1'961'503.00	0.07	a)
CH1323274097	1.2375 % BNG 1.2375 02/20/29	0	500	0	500 CHF	100.00%	500'000.00	0.02	a)
CH1325807878	1.4942 % SANUK 1.4942 11/12/28 EMTN	0	1'750	0	1'750 CHF	100.31%	1'755'495.00	0.06	a)
CH1326849630	1.5775 % LAUSAN 1.5775 03/01/2078	0	305	0	305 CHF	102.70%	313'235.00	0.01	a)
CH1331113444	1.2500 % STGALL 1 1/4 03/08/27	0	500	0	500 CHF	100.05%	500'265.00	0.02	a)
CH1331440235	1.4500 % KBSCHW 1.45 03/14/31	0	300	0	300 CHF	100.31%	300'936.00	0.01	a)

**CHF** **2'021'425'639.80** **71.85**

**Wertpapiere, die an einem anderen regelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden**

**765'837'424.74** **27.22**

**Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen**

**765'837'424.74** **27.22**

CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	0	191'172	191'172	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0215804664	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB CHF NT CHF	0	105'207	105'207	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.
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	4'956'289	3'107'904	86'786	7'977'407	CHF	96.00	765'837'424.74	27.22 a)
<b>CHF</b>								<b>765'837'424.74</b>	<b>27.22</b>

### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	10'817'811.92	0.38
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'021'425'639.80	71.85
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	765'837'424.74	27.22
Sonstige Vermögenswerte	15'494'311.65	0.55
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'813'575'188.11</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-49'927.82	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>2'813'525'260.29</b>	

### 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);	2'787'263'064.54	99.06
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

### Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.95288338
-----	---------	------------

## 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 Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.211	0.00 - 0.05	-	0.001
GT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.211	0.00 - 0.05	-	0.001
NT CHF	CHF	0.00 - 0.44	-	0.211	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	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
GT CHF	0.110	0.350	0.060	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® AAA-BBB 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	0.75000	0.26250	0.48750

## 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	0.81424	0.28498	0.52926
NT CHF	Nein	CHF	0.91645	0.32075	0.59570

## 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 Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich der Anteilklasse des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

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

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

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

## 5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

## 6 Vollzug der Vereinigung

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

## 7 Kosten

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

## 8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)</b>	20. Juli 2023
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF</b> (übernehmendes Teilvermögen)	<b>Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)</b>	20. Juli 2023
	<b>Geschlossen (kein Cut Off von/bis)</b>	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](http://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<sup>bis</sup> 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:

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)</b> (übertragendes Teilvermögen)			<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF</b> (übernehmendes Teilvermögen)		
	<b>ISIN</b>	<b>NAV pro Anteil</b>		<b>ISIN</b>	<b>NAV pro Anteil</b>
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):

<b>Swisscanto (CH) Pension Equity Fund Responsible Europe ex CH</b> (übertragendes Teilvermögen)	
<b>Anteilsklasse</b>	<b>Umtauschverhältnis<sup>1</sup></b>
FA CHF	1 ↔ 1.0000000000
DT CHF	1 ↔ 1.1202372991
GT CHF	1 ↔ 1.0000000000
NT CHF	1 ↔ 1.0000000000

<sup>1</sup> 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.

<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.</b> (übertragendes Teilvermögen)	<b>Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.</b> (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](http://www.fundinfo.com) veröffentlichen.

## 7 Kosten

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

## 8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

### (übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

### (übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

**Stichtag Vereinigung**

22. November 2023

## 9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

### Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

#### 1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

#### 2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

##### 2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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



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

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

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

## 2.2 Flüssige Mittel

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

## 2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens werden weitere Ergänzungen vorgenommen. Die in Ziff. 3 von § 13 erwähnte Grenze ist von 10% auf 20% angehoben, wenn es sich um Pfandbriefe schweizerischer Pfandbriefinstitute mit erstklassigem Rating (AAA Rating von Standard & Poor's bzw. ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) handelt. Pfandbriefe bleiben bei der Anwendung der Grenze von 40% nach Ziff. 3 ausser Betracht. Zudem wird neu festgehalten, dass wenn für die Verpflichtungen ein Emittent bzw. eine Gegenpartei wie ein Garant einsteht, kann bei der Beurteilung des Gesamtengagements bei besserem Rating auch auf den Garant abgestellt werden. Sollte das Rating einer Gegenpartei oder eines 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<sup>bis</sup> 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:

<b>Teilvermögen</b>	<b>Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)</b>
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 Anteilklassen 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<sup>bis</sup> 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