

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD (EX CHF) GOVT. (I)

## 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>
DTH1 CHF	11704532	CHF
FA CHF	127002024	CHF
FAH1 CHF	31562131	CHF
GT CHF	127002027	CHF
GTH1 CHF	33096815	CHF
NT CHF	127002029	CHF
NTH1 CHF	11704531	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 beigegefügte 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	Collateral ausgeliehene Effekten	39
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	39
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	40
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	40
8	Pauschale Verwaltungskommission	41
9	Benchmark	41
10	TER	42
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	42
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	42
13	Fussnoten	43
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	44
15	Pflichtpublikationen	46

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'239'149'039.41	1'011'107'250.39	981'248'192.20	1'199'186'259.19
<b>Klasse DTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			10'952'466.40	12'462'585.73	6'084'590.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode			116'032.595	114'262.676	53'641.746
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)			94.3913	109.0696	113.4301
Thesaurierung je Anteil			1.69	1.75	1.93
Total Expense Ratio (Synthetische TER)			0.20 %	0.20 %	0.22 %
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		889'994.99			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'385.098			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		71.8601			
Ausschüttung je Anteil		1.55			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %			
<b>Klasse FAH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		17'614'475.36	6'010'392.02	7'284'756.10	13'847'751.62
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		242'599.522	81'115.045	84'089.939	151'909.167
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		72.6072	74.0971	86.6305	91.1581
Ausschüttung je Anteil		1.55	1.40	1.40	1.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.20 %	0.20 %	0.21 %	0.24 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'609'353.75			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		319'093.080			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		77.1228			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		87.5848			
Thesaurierung je Anteil		1.64			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %			
<b>Klasse GTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		193'417'880.73	172'906'830.22	26'622'815.71	24'046'188.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'346'891.690	2'082'497.748	277'561.239	241'123.137
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		82.4145	83.0286	95.9169	99.7258
Thesaurierung je Anteil		1.76	1.52	1.58	1.74
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.18 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		87'139'867.45			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'064'034.139			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.8957			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		93.0052			
Thesaurierung je Anteil		1.86			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %			

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
<b>Klasse NTH1 CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		915'477'467.13	821'237'561.75	934'878'034.66	1'155'207'728.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'577'371.162	8'536'598.663	8'420'077.739	10'017'146.214
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		95.5876	96.2020	111.0296	115.3230
Thesaurierung je Anteil		2.19	1.92	2.01	2.22
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

## Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DTH1 CHF (Schliessung 10.08.2023)	-0.41 %	-0.51 %	-15.31 %	-3.56 %
Klasse FA CHF (Lancierung 25.07.2023)	1.32 %	-0.35 %	-	-
Klasse FAH1 CHF	-0.14 %	1.53 %	-15.32 %	-3.56 %
Klasse GT CHF (Lancierung 25.07.2023)	1.34 %	-0.34 %	-	-
Klasse GTH1 CHF	-0.10 %	1.57 %	-15.28 %	-3.52 %
Klasse NT CHF (Lancierung 25.07.2023)	1.42 %	-0.28 %	-	-
Klasse NTH1 CHF	0.06 %	1.73 %	-15.14 %	-3.36 %
Benchmark Hedge	0.18 %	1.89 %	-15.21 %	-
Benchmark	1.42 %	-0.23 %	-	-3.37 %
Tracking Error 33)	5.60 %	4.91 %	0.12 %	0.05 %

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 DTH1 CHF (Schliessung 10.08.2023)	-0.59 %
Klasse FA CHF (Lancierung 25.07.2023)	-0.10 %
Klasse FAH1 CHF	-0.32 %
Klasse GT CHF (Lancierung 25.07.2023)	-0.08 %
Klasse GTH1 CHF	-0.28 %
Klasse NT CHF (Lancierung 25.07.2023)	-
Klasse NTH1 CHF	-0.12 %

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	6'095'868.15	5'986'447.54
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	663'102'723.22	574'051'207.69
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	591'274'267.63	433'778'508.31
Derivative Finanzinstrumente	3'198.93	-5'821'910.06
Sonstige Vermögenswerte	5'387'208.74	3'136'706.40
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'265'863'266.67</b>	<b>1'011'130'959.88</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-26'681'862.20	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-32'365.06	-23'709.49
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'239'149'039.41</b>	<b>1'011'107'250.39</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Klasse DTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		116'032.595	114'262.676
Ausgegebene Anteile		13'749.438	2'310.205
Zurückgenommene Anteile		-129'782.033	-540.286
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		-	<b>116'032.595</b>

	von bis	Lancierung 25.07.2023 29.02.2024	
<b>Klasse FA CHF</b>			
Ausgegebene Anteile		2'608.270	
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		14'101.117	
Zurückgenommene Anteile		-4'324.289	
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>12'385.098</b>	

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Klasse FAH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		81'115.045	84'089.939
Ausgegebene Anteile		195'942.834	8'978.006
Zurückgenommene Anteile		-34'458.357	-11'952.900
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>242'599.522</b>	<b>81'115.045</b>

	von bis	Lancierung 25.07.2023 29.02.2024	
<b>Klasse GT CHF</b>			
Ausgegebene Anteile		46'846.270	
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		293'393.910	
Zurückgenommene Anteile		-21'147.100	
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>319'093.080</b>	

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Klasse GTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'082'497.748	277'561.239
Ausgegebene Anteile		728'645.848	1'978'385.434
Zurückgenommene Anteile		-464'251.906	-173'448.925
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'346'891.690</b>	<b>2'082'497.748</b>

	von bis	Lancierung 25.07.2023 29.02.2024	
<b>Klasse NT CHF</b>			
Ausgegebene Anteile		57'393.578	
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		1'168'679.429	
Zurückgenommene Anteile		-162'038.868	
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'064'034.139</b>	

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Klasse NTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'536'598.663	8'420'077.739
Ausgegebene Anteile		2'483'609.860	1'950'629.764
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	29'757.587
Zurückgenommene Anteile		-1'442'837.361	-1'863'866.427
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>9'577'371.162</b>	<b>8'536'598.663</b>

Lancierung

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'011'107'250.39	981'248'192.20
Ausbezahlte Ausschüttung		-115'497.55	-118'388.70
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-7'345'508.24	-5'960'026.08
Saldo aus dem Anteilverkehr		230'735'039.45	159'279'931.44
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		4'767'755.36	-123'342'458.47
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'239'149'039.41</b>	<b>1'011'107'250.39</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		73'438.15	7'644.85
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-2'482.37	-8'987.11
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		13'240'886.92	8'937'233.81
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		11'962'507.74	7'812'853.87
Erträge aus Wertpapierleihe		95'594.20	63'802.90
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds		1'654'239.89	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'670'118.31	5'370'101.41
<b>Total Ertrag</b>		<b>31'694'302.84</b>	<b>22'182'649.73</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-1'018.66	-1'249.65
Reglementarische Vergütungen		-368'042.27	-87'153.37
Sonstige Aufwendungen		-407.30	-499.85
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-3'253'429.88	-2'136'543.23
<b>Total Aufwand</b>		<b>-3'622'898.11</b>	<b>-2'225'446.10</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>28'071'404.73</b>	<b>19'957'203.63</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-8'339'770.94	-3'005'839.92
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		326'132.70	436'147.06
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>20'057'766.49</b>	<b>17'387'510.77</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-15'290'011.13	-140'729'969.24
<b>Gesamterfolg</b>		<b>4'767'755.36</b>	<b>-123'342'458.47</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse DTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	0.00	196'764.45
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>0.00</b>	<b>196'764.45</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	68'867.56
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	0.00	127'896.89
<b>Total</b>	<b>0.00</b>	<b>196'764.45</b>
Klasse FA CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	18'714.82	
Vortrag des Vorjahres aus übernommenen Fonds	647.22	
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>19'362.04</b>	
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	19'196.90	
Vortrag auf neue Rechnung	165.14	
<b>Total</b>	<b>19'362.04</b>	
Klasse FAH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	378'726.23	108'526.90
Vortrag des Vorjahres	3'312.36	8'346.52
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>382'038.59</b>	<b>116'873.42</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	376'029.26	113'561.06
Vortrag auf neue Rechnung	6'009.33	3'312.36
<b>Total</b>	<b>382'038.59</b>	<b>116'873.42</b>
Klasse GT CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	525'431.63	
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>525'431.63</b>	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	183'901.07	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	341'530.56	
<b>Total</b>	<b>525'431.63</b>	
Klasse GTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	4'135'722.38	3'178'766.97
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>4'135'722.38</b>	<b>3'178'766.97</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'447'502.83	1'112'568.44
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'688'219.55	2'066'198.53
<b>Total</b>	<b>4'135'722.38</b>	<b>3'178'766.97</b>
Klasse NT CHF	29.02.2024	
Nettoertrag	1'981'767.00	
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>1'981'767.00</b>	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	693'618.45	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'288'148.55	
<b>Total</b>	<b>1'981'767.00</b>	
Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	21'031'042.67	16'473'145.31
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>21'031'042.67</b>	<b>16'473'145.31</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'360'864.93	5'765'600.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	13'670'177.74	10'707'544.45
<b>Total</b>	<b>21'031'042.67</b>	<b>16'473'145.31</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>663'102'723.22</b>	<b>52.38</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>663'102'723.22</b>	<b>52.38</b>	
JP1024321N19	0.0050 % JGB 0.005 01/01/24 432	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	80'000	0	80'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024341N31	0.0050 % JGB 0.005 03/01/24 434	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024351N46	0.0050 % JGB 0.005 04/01/24 435	70'000	0	70'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024361N51	0.0050 % JGB 0.005 05/01/24 436	90'000	0	90'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024371N67	0.0050 % JGB 0.005 06/01/24 437	80'000	0	80'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024381N73	0.0050 % JGB 0.005 07/01/24 438	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024391N89	0.0050 % JGB 0.005 08/01/24 439	20'000	9'000	29'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024401N95	0.0050 % JGB 0.005 09/01/24 440	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	54'000	0	54'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024421NB7	0.0050 % JGB 0.005 11/01/24 442	144'000	0	144'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	123'000	0	123'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024441P12	0.0050 % JGB 0.005 01/01/25 444	142'000	0	142'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024451P27	0.0050 % JGB 0.005 02/01/25 445	0	120'000	60'000	60'000 JPY	99.98%	352'915.61	0.03	a)
JP1024461P33	0.0050 % JGB 0.005 03/01/25 446	0	117'000	0	117'000 JPY	99.95%	688'027.12	0.05	a)
JP1024471P49	0.0050 % JGB 0.005 04/01/25 447	0	131'000	0	131'000 JPY	99.94%	770'239.55	0.06	a)
JP1024481P54	0.0050 % JGB 0.005 05/01/25 448	0	65'000	0	65'000 JPY	99.92%	382'114.92	0.03	a)
JP1024491P60	0.0050 % JGB 0.005 06/01/25 449	0	110'000	0	110'000 JPY	99.91%	646'604.24	0.05	a)
JP1024501P76	0.0050 % JGB 0.005 07/01/25 450	0	85'000	0	85'000 JPY	99.88%	499'488.71	0.04	a)
JP1024511P82	0.0050 % JGB 0.005 08/01/25 451	0	85'000	0	85'000 JPY	99.86%	499'373.69	0.04	a)
JP1024521P98	0.0050 % JGB 0.005 09/01/25 452	0	145'000	0	145'000 JPY	99.82%	851'531.53	0.07	a)
JP1024531PA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/25 453	0	100'000	0	100'000 JPY	99.79%	587'104.28	0.05	a)
JP1024541PB7	0.1000 % JGB 0.1 11/01/25 454	0	85'000	0	85'000 JPY	99.90%	499'593.72	0.04	a)
JP1024561Q15	0.1000 % JGB 0.1 01/01/26 456	0	40'000	0	40'000 JPY	99.87%	235'027.62	0.02	a)
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	100'000	0	100'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	100'000	20'000	120'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051411KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/24 141	80'000	0	80'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	78'000	10'000	88'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	96'000	10'000	0	106'000 JPY	100.05%	623'908.31	0.05	a)
JP1051441L76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/25 144	140'000	12'000	0	152'000 JPY	100.01%	894'374.81	0.07	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	70'000	10'000	0	80'000 JPY	99.97%	470'497.67	0.04	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	91'000	10'000	0	101'000 JPY	99.90%	593'617.07	0.05	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	70'000	10'000	0	80'000 JPY	99.66%	469'062.15	0.04	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	60'000	25'950	0	85'950 JPY	99.61%	503'680.64	0.04	a)
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	85'000	20'000	0	105'000 JPY	99.55%	614'976.91	0.05	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	110'000	0	0	110'000 JPY	99.47%	643'717.90	0.05	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	100'000	15'300	0	115'300 JPY	99.42%	674'434.93	0.05	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	110'000	17'000	56'000	71'000 JPY	99.71%	416'509.87	0.03	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	174'000	42'000	60'000	156'000 JPY	99.30%	911'367.14	0.07	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	196'000	0	0	196'000 JPY	99.50%	1'147'357.27	0.09	a)
JP1051551P11	0.3000 % JGB 0.3 12/20/27 155	0	75'000	0	75'000 JPY	100.13%	441'819.62	0.03	a)
JP1051561P27	0.2000 % JGB 0.2 12/20/27 156	0	50'000	0	50'000 JPY	99.75%	293'437.41	0.02	a)
JP1051571P41	0.2000 % JGB 0.2 03/20/28 157	0	107'000	0	107'000 JPY	99.65%	627'288.79	0.05	a)
JP1051581P56	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 158	0	216'700	0	216'700 JPY	99.25%	1'265'306.73	0.10	a)
JP1051601P86	0.2000 % JGB 0.2 06/20/28 160	0	54'400	0	54'400 JPY	99.55%	318'610.21	0.03	a)
JP1051621PA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/28 162	0	60'000	0	60'000 JPY	99.85%	352'460.24	0.03	a)
JP1051631PB2	0.4000 % JGB 0.4 09/20/28 163	0	275'000	0	275'000 JPY	100.30%	1'622'707.17	0.13	a)
JP1051641Q12	0.2000 % JGB 0.2 12/20/28 164	0	100'000	0	100'000 JPY	99.24%	583'827.29	0.05	a)
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	83'000	0	83'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103331E36	0.6000 % JGB 0.6 03/20/24 333	70'000	0	70'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103341E67	0.6000 % JGB 0.6 06/20/24 334	85'000	19'000	104'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	100'000	35'000	135'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103361EC6	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/24 336	28'000	0	28'000	0 JPY	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.
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	30'000	7'000	37'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	43'000	0	0	43'000 JPY	100.37%	253'919.60	0.02 a)	
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	95'000	30'000	0	125'000 JPY	100.40%	738'381.06	0.06 a)	
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	40'000	20'000	0	60'000 JPY	100.43%	354'518.22	0.03 a)	
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	45'000	10'000	0	55'000 JPY	100.26%	324'421.71	0.03 a)	
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	35'000	0	0	35'000 JPY	99.85%	205'614.16	0.02 a)	
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	60'000	10'000	26'000	44'000 JPY	99.83%	258'411.31	0.02 a)	
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	70'000	0	0	70'000 JPY	99.79%	410'981.23	0.03 a)	
JP1103451GCO	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	127'000	20'000	51'000	96'000 JPY	99.73%	563'292.53	0.04 a)	
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	80'000	0	0	80'000 JPY	99.71%	469'306.89	0.04 a)	
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	86'000	10'000	15'000	81'000 JPY	99.61%	474'696.68	0.04 a)	
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	83'000	30'000	0	113'000 JPY	99.50%	661'486.59	0.05 a)	
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	69'000	15'000	0	84'000 JPY	99.38%	491'111.74	0.04 a)	
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	64'000	7'000	0	71'000 JPY	99.25%	414'567.50	0.03 a)	
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	67'000	5'000	0	72'000 JPY	99.13%	419'889.69	0.03 a)	
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	58'000	0	0	58'000 JPY	98.95%	337'647.32	0.03 a)	
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	74'000	0	20'000	54'000 JPY	98.81%	313'913.35	0.02 a)	
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	62'000	6'000	0	68'000 JPY	98.72%	394'954.23	0.03 a)	
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	65'000	0	25'000	40'000 JPY	98.63%	232'104.81	0.02 a)	
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	64'000	10'000	27'000	47'000 JPY	98.53%	272'460.46	0.02 a)	
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	151'000	10'000	106'000	55'000 JPY	98.44%	318'516.37	0.03 a)	
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	0	47'000	0	47'000 JPY	98.32%	271'865.96	0.02 a)	
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	120'000	0	40'000	80'000 JPY	98.14%	461'889.25	0.04 a)	
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	65'000	10'000	20'000	55'000 JPY	97.95%	316'934.06	0.03 a)	
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	92'000	0	35'000	57'000 JPY	97.75%	327'788.24	0.03 a)	
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	98'000	16'000	53'000	61'000 JPY	97.54%	350'033.69	0.03 a)	
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	144'000	20'000	75'000	89'000 JPY	97.22%	509'055.51	0.04 a)	
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	75'000	22'000	19'000	78'000 JPY	96.96%	444'950.00	0.04 a)	
JP1103651N11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/31 365	60'000	14'000	0	74'000 JPY	96.70%	420'973.98	0.03 a)	
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	0	46'000	0	46'000 JPY	96.96%	262'390.17	0.02 a)	
JP1103691P11	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/32 369	0	39'000	0	39'000 JPY	98.95%	227'038.72	0.02 a)	
JP1103701P43	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/33 370	0	281'950	113'000	168'950 JPY	98.75%	981'545.47	0.08 a)	
JP1103711P74	0.4000 % JGB 0.4 06/20/33 371	0	196'350	0	196'350 JPY	97.60%	1'127'446.11	0.09 a)	
JP1103721PA1	0.8000 % JGB 0.8 09/20/33 372	0	237'000	30'000	207'000 JPY	101.06%	1'230'687.16	0.10 a)	
JP1103731Q12	0.6000 % JGB 0.6 12/20/33 373	0	70'000	0	70'000 JPY	98.99%	407'649.53	0.03 a)	
JP1200671434	1.9000 % JGB 1.9 03/20/24 67	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200691457	2.1000 % JGB 2.1 03/20/24 69	45'000	0	45'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200701462	2.4000 % JGB 2.4 06/20/24 70	50'000	20'000	70'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	42'000	8'000	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200751533	2.1000 % JGB 2.1 03/20/25 75	30'000	10'000	0	40'000 JPY	102.16%	240'409.65	0.02 a)	
JP1200761540	1.9000 % JGB 1.9 03/20/25 76	30'000	10'000	0	40'000 JPY	101.95%	239'915.45	0.02 a)	
JP1200781563	1.9000 % JGB 1.9 06/20/25 78	0	6'000	0	6'000 JPY	102.36%	36'132.05	0.00 a)	
JP1200811592	2.0000 % JGB 2 09/20/25 81	30'000	0	0	30'000 JPY	102.92%	181'645.09	0.01 a)	
JP12008215A7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/25 82	20'000	0	0	20'000 JPY	103.07%	121'279.11	0.01 a)	
JP12008315C1	2.1000 % JGB 2.1 12/20/25 83	30'000	0	0	30'000 JPY	103.50%	182'677.61	0.01 a)	
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	40'000	0	0	40'000 JPY	103.32%	243'146.55	0.02 a)	
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	50'000	10'000	0	60'000 JPY	103.94%	366'918.99	0.03 a)	
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	25'000	5'000	0	30'000 JPY	104.35%	184'181.38	0.01 a)	
JP1200871653	2.2000 % JGB 2.2 03/20/26 87	40'000	0	0	40'000 JPY	104.15%	245'092.74	0.02 a)	
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	78'000	0	15'000	63'000 JPY	104.87%	388'711.96	0.03 a)	
JP1200891685	2.2000 % JGB 2.2 06/20/26 89	25'000	0	0	25'000 JPY	104.64%	153'912.49	0.01 a)	
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	72'000	10'000	0	82'000 JPY	105.14%	507'211.34	0.04 a)	
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	96'000	0	0	96'000 JPY	105.34%	594'971.87	0.05 a)	
JP1200931739	2.0000 % JGB 2 03/20/27 93	50'000	0	0	50'000 JPY	105.48%	310'275.36	0.02 a)	
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	54'000	10'000	0	64'000 JPY	105.78%	398'293.35	0.03 a)	
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	50'000	0	0	50'000 JPY	106.86%	314'355.42	0.02 a)	
JP1200961785	2.1000 % JGB 2.1 06/20/27 96	25'000	0	0	25'000 JPY	106.21%	156'212.85	0.01 a)	
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	45'000	0	0	45'000 JPY	106.94%	283'126.38	0.02 a)	
JP12009817B7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/27 98	30'000	6'000	0	36'000 JPY	106.59%	225'753.46	0.02 a)	
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	92'000	25'000	0	117'000 JPY	106.95%	736'197.42	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.
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	70'000	20'000	0	90'000 JPY	107.70%	570'271.63	0.05	a)
JP1201011853	2.4000 % JGB 2.4 03/20/28 101	30'000	0	0	30'000 JPY	108.50%	191'504.29	0.02	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	57'000	20'000	0	77'000 JPY	108.94%	493'520.94	0.04	a)
JP1201031877	2.3000 % JGB 2.3 06/20/28 103	35'000	0	0	35'000 JPY	108.52%	223'452.56	0.02	a)
JP1201041884	2.1000 % JGB 2.1 06/20/28 104	30'000	0	0	30'000 JPY	107.67%	190'030.53	0.02	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	50'000	6'000	0	56'000 JPY	107.98%	355'738.41	0.03	a)
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	30'000	3'000	0	33'000 JPY	108.42%	210'503.29	0.02	a)
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	30'000	0	0	30'000 JPY	108.31%	191'167.18	0.02	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	50'000	0	0	50'000 JPY	107.37%	315'832.12	0.02	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	40'000	0	0	40'000 JPY	107.71%	253'470.53	0.02	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	60'000	0	0	60'000 JPY	108.70%	383'711.05	0.03	a)
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	50'000	0	0	50'000 JPY	109.67%	322'615.54	0.03	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	50'000	15'000	0	65'000 JPY	109.15%	417'407.83	0.03	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	60'000	0	0	60'000 JPY	109.54%	386'679.75	0.03	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	64'000	20'000	23'000	61'000 JPY	109.92%	394'495.34	0.03	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	30'000	10'000	0	40'000 JPY	110.49%	260'022.15	0.02	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	50'000	10'000	0	60'000 JPY	110.87%	391'367.55	0.03	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	92'000	10'000	0	102'000 JPY	110.28%	661'772.28	0.05	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	40'000	10'000	0	50'000 JPY	109.95%	323'439.20	0.03	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	39'000	0	0	39'000 JPY	108.72%	249'458.07	0.02	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	50'000	10'000	0	60'000 JPY	107.49%	379'436.26	0.03	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	64'000	0	0	64'000 JPY	109.57%	412'560.07	0.03	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	51'000	25'000	37'000	39'000 JPY	108.93%	249'937.62	0.02	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	90'000	19'000	0	109'000 JPY	111.11%	712'504.21	0.06	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	50'000	20'000	19'000	51'000 JPY	110.45%	331'387.22	0.03	a)
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	66'000	0	0	66'000 JPY	112.11%	435'311.42	0.03	a)
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	40'000	15'000	0	55'000 JPY	110.66%	358'083.78	0.03	a)
JP1201271B58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/31 127	35'000	10'000	0	45'000 JPY	109.98%	291'166.76	0.02	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	80'000	10'000	16'000	74'000 JPY	110.06%	479'177.62	0.04	a)
JP1201291B88	1.8000 % JGB 1.8 06/20/31 129	40'000	10'000	20'000	30'000 JPY	109.36%	193'015.12	0.02	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	84'000	0	0	84'000 JPY	109.48%	541'055.14	0.04	a)
JP1201311BB0	1.7000 % JGB 1.7 09/20/31 131	45'000	0	0	45'000 JPY	108.75%	287'923.60	0.02	a)
JP1201321BC7	1.7000 % JGB 1.7 12/20/31 132	69'000	10'000	15'000	64'000 JPY	108.92%	410'123.92	0.03	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	70'000	10'000	0	80'000 JPY	109.67%	516'184.87	0.04	a)
JP1201341C38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/32 134	55'000	27'000	0	82'000 JPY	109.86%	529'996.46	0.04	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	30'000	0	0	30'000 JPY	109.00%	192'388.55	0.02	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	40'000	0	0	40'000 JPY	108.23%	254'701.31	0.02	a)
JP1201371C64	1.7000 % JGB 1.7 06/20/32 137	38'000	0	0	38'000 JPY	109.09%	243'893.37	0.02	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	40'000	0	0	40'000 JPY	107.51%	252'995.16	0.02	a)
JP1201391C86	1.6000 % JGB 1.6 06/20/32 139	40'000	10'000	0	50'000 JPY	108.30%	318'579.61	0.03	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	125'000	45'000	20'000	150'000 JPY	109.17%	963'407.69	0.08	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	70'000	29'000	0	99'000 JPY	109.24%	636'250.96	0.05	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	52'000	5'000	0	57'000 JPY	110.17%	369'441.69	0.03	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	76'000	7'000	0	83'000 JPY	108.43%	529'496.49	0.04	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	50'000	10'000	15'000	45'000 JPY	107.58%	284'807.53	0.02	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	103'000	10'000	20'000	93'000 JPY	109.36%	598'374.23	0.05	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	97'000	10'000	0	107'000 JPY	109.42%	688'836.07	0.05	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	89'000	10'000	20'000	79'000 JPY	108.45%	504'052.96	0.04	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	97'000	36'000	0	133'000 JPY	107.41%	840'442.08	0.07	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	88'000	21'000	0	109'000 JPY	107.33%	688'289.57	0.05	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	122'000	10'950	15'000	117'950 JPY	106.37%	738'136.40	0.06	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	95'000	41'000	19'000	117'000 JPY	104.25%	717'625.90	0.06	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	109'000	10'000	0	119'000 JPY	104.09%	728'730.83	0.06	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	80'000	31'000	15'000	96'000 JPY	105.05%	593'328.32	0.05	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	84'000	35'000	0	119'000 JPY	103.83%	726'952.55	0.06	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	107'000	12'000	0	119'000 JPY	101.38%	709'792.85	0.06	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	65'000	15'000	0	80'000 JPY	94.41%	444'342.96	0.04	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	80'000	51'000	35'500	95'500 JPY	91.74%	515'461.02	0.04	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	100'000	31'000	0	131'000 JPY	94.91%	731'442.02	0.06	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	107'000	15'000	0	122'000 JPY	95.69%	686'831.87	0.05	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	99'000	28'000	25'000	102'000 JPY	96.61%	579'769.36	0.05	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	70'000	45'000	18'000	97'000 JPY	95.11%	542'766.29	0.04	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	113'000	71'000	50'000	134'000 JPY	94.75%	746'962.76	0.06	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	101'000	30'000	15'000	116'000 JPY	94.39%	644'201.75	0.05	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	120'000	38'300	29'000	129'300 JPY	92.70%	705'138.38	0.06	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	132'000	31'000	10'000	153'000 JPY	92.30%	830'866.92	0.07	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	90'000	52'000	25'000	117'000 JPY	94.64%	651'455.42	0.05	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	105'000	39'000	15'000	129'000 JPY	91.63%	695'389.22	0.05	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	103'000	23'500	0	126'500 JPY	89.80%	668'322.96	0.05	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	140'000	48'000	36'000	152'000 JPY	87.93%	786'348.38	0.06	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	110'000	73'000	53'000	130'000 JPY	87.56%	669'697.29	0.05	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	148'000	16'700	0	164'700 JPY	87.07%	843'716.66	0.07	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	133'000	16'000	0	149'000 JPY	88.14%	772'660.46	0.06	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	179'000	70'000	56'000	193'000 JPY	87.66%	995'332.96	0.08	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	172'000	66'000	48'000	190'000 JPY	87.23%	975'077.18	0.08	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	171'000	20'000	0	191'000 JPY	88.29%	992'075.50	0.08	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	164'000	0	10'000	154'000 JPY	87.87%	796'088.03	0.06	a)
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	179'000	45'000	0	224'000 JPY	85.93%	1'132'419.38	0.09	a)
JP1201781MA3	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/41 178	170'000	48'000	25'000	193'000 JPY	87.01%	988'009.16	0.08	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	190'000	45'000	20'000	215'000 JPY	86.71%	1'096'736.05	0.09	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	166'000	26'000	0	192'000 JPY	91.21%	1'030'310.12	0.08	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	158'000	39'000	0	197'000 JPY	92.53%	1'072'405.22	0.08	a)
JP1201821NA5	1.1000 % JGB 1.1 09/20/42 182	169'000	17'000	22'000	164'000 JPY	95.48%	921'265.64	0.07	a)
JP1201831P14	1.4000 % JGB 1.4 12/20/42 183	64'000	101'000	0	165'000 JPY	100.15%	972'168.19	0.08	a)
JP1201841P46	1.1000 % JGB 1.1 03/20/43 184	0	184'000	25'000	159'000 JPY	95.02%	888'856.53	0.07	a)
JP1201851P76	1.1000 % JGB 1.1 06/20/43 185	0	180'150	0	180'150 JPY	94.63%	1'003'000.11	0.08	a)
JP1201861PA6	1.5000 % JGB 1 1/2 09/20/43 186	0	191'000	0	191'000 JPY	101.24%	1'137'640.44	0.09	a)
JP1201871Q14	1.3000 % JGB 1.3 12/20/43 187	0	60'000	0	60'000 JPY	97.51%	344'214.24	0.03	a)
JP1300071253	2.3000 % JGB 2.3 05/20/32 7	35'000	0	0	35'000 JPY	113.97%	234'670.80	0.02	a)
JP13000812B5	1.8000 % JGB 1.8 11/22/32 8	25'000	0	0	25'000 JPY	110.05%	161'866.68	0.01	a)
JP1300101357	1.1000 % JGB 1.1 03/20/33 10	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	30'000	10'000	0	40'000 JPY	109.36%	257'365.26	0.02	a)
JP13001213B5	2.1000 % JGB 2.1 09/20/33 12	20'000	0	0	20'000 JPY	113.12%	133'108.03	0.01	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	31'000	0	0	31'000 JPY	112.23%	204'686.96	0.02	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	40'000	10'000	0	50'000 JPY	116.07%	341'436.15	0.03	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	53'000	10'000	0	63'000 JPY	117.25%	434'572.07	0.03	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	30'000	20'000	15'000	35'000 JPY	117.48%	241'900.47	0.02	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	40'000	0	0	40'000 JPY	116.57%	274'325.58	0.02	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	50'000	10'000	0	60'000 JPY	115.73%	408'526.73	0.03	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	30'000	11'000	0	41'000 JPY	115.89%	279'533.81	0.02	a)
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	33'000	0	0	33'000 JPY	118.03%	229'153.17	0.02	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	40'000	0	0	40'000 JPY	115.92%	272'798.28	0.02	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	49'000	20'000	20'000	49'000 JPY	118.23%	340'834.30	0.03	a)
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	54'000	12'000	13'000	53'000 JPY	118.39%	369'147.05	0.03	a)
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	30'000	9'700	0	39'700 JPY	118.53%	276'836.69	0.02	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	45'000	10'000	12'000	43'000 JPY	116.09%	293'690.75	0.02	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	99'000	18'000	25'000	92'000 JPY	117.34%	635'116.55	0.05	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	87'000	51'000	45'000	93'000 JPY	118.73%	649'614.36	0.05	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	120'000	25'000	20'000	125'000 JPY	118.77%	873'446.46	0.07	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	108'000	56'000	55'000	109'000 JPY	117.51%	753'565.21	0.06	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	117'000	40'000	11'000	146'000 JPY	115.95%	995'919.87	0.08	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	100'000	36'000	10'000	126'000 JPY	114.45%	848'395.33	0.07	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	131'000	47'000	30'000	148'000 JPY	115.71%	1'007'525.11	0.08	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	144'000	36'000	0	180'000 JPY	111.01%	1'175'564.06	0.09	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	135'000	47'000	27'000	155'000 JPY	113.77%	1'037'487.31	0.08	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	162'000	30'000	10'000	182'000 JPY	110.40%	1'182'158.51	0.09	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	145'000	54'750	32'000	167'750 JPY	110.30%	1'088'582.87	0.09	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	177'000	50'000	15'000	212'000 JPY	108.61%	1'354'668.99	0.11	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	95'000	34'000	15'000	114'000 JPY	106.61%	715'053.62	0.06	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	80'000	43'000	15'000	108'000 JPY	108.16%	687'210.64	0.05	a)
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	70'000	10'000	0	80'000 JPY	106.32%	500'408.26	0.04	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	71'000	16'000	15'000	72'000 JPY	104.38%	442'136.96	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.
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	70'000	21'000	0	91'000 JPY	104.31%	558'453.29	0.04	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	59'000	10'000	0	69'000 JPY	104.07%	422'464.28	0.03	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	63'000	20'000	20'000	63'000 JPY	103.99%	385'428.03	0.03	a)
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	52'000	0	0	52'000 JPY	100.23%	306'628.08	0.02	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	70'000	47'350	28'000	89'350 JPY	100.11%	526'254.57	0.04	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	41'000	0	0	41'000 JPY	101.77%	245'491.21	0.02	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	30'000	10'000	0	40'000 JPY	97.93%	230'459.84	0.02	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	48'000	10'000	0	58'000 JPY	97.63%	333'156.73	0.03	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	65'000	9'000	0	74'000 JPY	86.36%	375'987.95	0.03	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	66'000	24'000	16'000	74'000 JPY	76.74%	334'101.70	0.03	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	75'000	44'000	17'000	102'000 JPY	80.08%	480'561.72	0.04	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	68'000	0	0	68'000 JPY	81.73%	326'963.52	0.03	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	57'000	22'000	25'000	54'000 JPY	85.35%	271'160.85	0.02	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	65'000	30'000	14'000	81'000 JPY	85.13%	405'688.10	0.03	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	73'000	38'000	26'000	85'000 JPY	84.77%	423'911.80	0.03	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	85'000	30'000	25'000	90'000 JPY	84.55%	447'682.90	0.04	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	97'000	20'000	31'000	86'000 JPY	84.33%	426'662.64	0.03	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	108'000	32'000	15'000	125'000 JPY	81.97%	602'844.99	0.05	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	64'000	45'000	38'000	71'000 JPY	85.75%	358'201.33	0.03	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	93'000	11'000	0	104'000 JPY	81.51%	498'721.88	0.04	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	85'000	36'600	44'000	77'600 JPY	77.01%	351'592.53	0.03	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	95'000	10'000	0	105'000 JPY	74.65%	461'127.66	0.04	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	75'000	52'000	37'000	90'000 JPY	74.38%	393'854.41	0.03	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	105'000	52'650	30'000	127'650 JPY	73.99%	555'680.43	0.04	a)
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	95'000	24'700	0	119'700 JPY	73.73%	519'227.76	0.04	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	125'000	10'000	0	135'000 JPY	77.64%	616'681.88	0.05	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	136'000	17'000	0	153'000 JPY	77.26%	695'485.59	0.05	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	133'000	69'000	35'000	167'000 JPY	79.08%	776'967.14	0.06	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	132'000	14'000	0	146'000 JPY	78.85%	677'280.49	0.05	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	120'000	39'000	26'000	133'000 JPY	78.61%	615'135.87	0.05	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	128'000	37'000	0	165'000 JPY	78.24%	759'498.21	0.06	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	139'000	22'000	0	161'000 JPY	78.15%	740'214.70	0.06	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	143'000	15'000	0	158'000 JPY	84.48%	785'253.62	0.06	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	144'000	18'000	30'000	132'000 JPY	90.86%	705'612.36	0.06	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	115'000	26'300	0	141'300 JPY	92.92%	772'459.21	0.06	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	56'000	75'000	0	131'000 JPY	97.30%	749'877.40	0.06	a)
JP1300781P48	1.4000 % JGB 1.4 03/20/53 78	0	160'000	0	160'000 JPY	92.76%	873'125.82	0.07	a)
JP1300791P79	1.2000 % JGB 1.2 06/20/53 79	0	151'000	0	151'000 JPY	88.06%	782'276.62	0.06	a)
JP1300801PA2	1.8000 % JGB 1.8 09/20/53 80	0	123'000	0	123'000 JPY	101.51%	734'541.51	0.06	a)
JP1300811Q17	1.6000 % JGB 1.6 12/20/53 81	0	55'000	0	55'000 JPY	96.86%	313'432.92	0.02	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	32'000	12'000	8'000	36'000 JPY	116.08%	245'863.68	0.02	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	64'000	23'000	15'000	72'000 JPY	111.92%	474'076.11	0.04	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	63'000	10'000	12'000	61'000 JPY	111.65%	400'675.25	0.03	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	73'000	23'000	0	96'000 JPY	111.13%	627'667.85	0.05	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	84'000	50'000	31'000	103'000 JPY	106.53%	645'554.25	0.05	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	55'000	28'000	20'000	63'000 JPY	104.13%	385'946.93	0.03	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	55'000	10'000	0	65'000 JPY	99.26%	379'594.81	0.03	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	54'000	20'000	10'850	63'150 JPY	91.87%	341'312.67	0.03	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	104'000	34'000	0	138'000 JPY	67.17%	545'323.93	0.04	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	117'000	31'000	32'000	116'000 JPY	78.70%	537'110.05	0.04	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	112'000	13'500	0	125'500 JPY	75.48%	557'293.05	0.04	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	119'000	34'000	0	153'000 JPY	67.08%	603'779.14	0.05	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	176'000	76'000	32'000	220'000 JPY	66.12%	855'805.44	0.07	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	178'000	62'000	35'000	205'000 JPY	70.55%	850'823.77	0.07	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	132'000	121'800	45'000	208'800 JPY	77.71%	954'575.22	0.08	a)
JP1400161P53	1.3000 % JGB 1.3 03/20/63 16	0	139'100	0	139'100 JPY	85.17%	696'959.91	0.06	a)
<b>JPY</b>							<b>139'841'488.33</b>	<b>11.05</b>	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	456	98	0	554 USD	102.39%	499'486.73	0.04	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	389	0	0	389 USD	105.77%	362'283.15	0.03	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	505	0	0	505 USD	103.88%	461'909.01	0.04	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	263	104	0	367 USD	110.41%	356'790.88	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.
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	226	161	0	387 USD	106.88%	364'200.98	0.03	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	392	50	0	442 USD	103.42%	402'521.16	0.03	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	436	150	250	336 USD	107.86%	319'117.94	0.03	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	200	320	130	390 USD	101.11%	347'224.27	0.03	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	337	60	0	397 USD	102.20%	357'279.98	0.03	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	523	0	100	423 USD	90.91%	338'600.92	0.03	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	400	263	0	663 USD	98.88%	577'236.85	0.05	a)
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	568	110	0	678 USD	101.56%	606'341.23	0.05	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	722	80	0	802 USD	99.94%	705'759.72	0.06	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	528	114	0	642 USD	102.66%	580'329.23	0.05	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	613	104	0	717 USD	99.56%	628'592.18	0.05	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	551	0	0	551 USD	93.47%	453'494.53	0.04	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	758	135	400	493 USD	97.70%	424'140.14	0.03	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	744	73	0	817 USD	103.66%	745'712.75	0.06	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	820	147	300	667 USD	98.88%	580'719.42	0.05	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	681	169	0	850 USD	91.19%	682'508.80	0.05	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	626	200	0	826 USD	83.22%	605'278.52	0.05	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	744	186	150	780 USD	82.89%	569'316.82	0.04	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	518	287	0	805 USD	81.02%	574'273.35	0.05	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	540	358	0	898 USD	77.78%	615'042.72	0.05	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	902	699	400	1'201 USD	77.48%	819'428.74	0.06	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	872	245	0	1'117 USD	82.06%	807'145.71	0.06	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'333	305	0	1'638 USD	78.67%	1'134'716.70	0.09	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	1'040	114	0	1'154 USD	88.14%	895'645.05	0.07	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	1'130	119	0	1'249 USD	89.66%	986'045.67	0.08	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	1'082	442	0	1'524 USD	87.89%	1'179'455.38	0.09	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	964	222	0	1'186 USD	84.53%	882'787.15	0.07	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	1'399	188	0	1'587 USD	81.13%	1'133'667.40	0.09	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	965	406	0	1'371 USD	79.31%	957'487.51	0.08	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	1'703	121	0	1'824 USD	72.47%	1'163'937.41	0.09	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	656	384	150	890 USD	79.08%	619'726.92	0.05	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	878	545	300	1'123 USD	77.20%	763'428.96	0.06	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	480	70	0	550 USD	78.78%	381'539.57	0.03	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	1'355	138	0	1'493 USD	71.75%	943'269.38	0.07	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	1'110	340	0	1'450 USD	71.56%	913'708.21	0.07	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	1'541	340	0	1'881 USD	67.91%	1'124'741.10	0.09	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	865	0	0	865 USD	76.50%	582'681.95	0.05	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	1'364	646	350	1'660 USD	78.14%	1'142'191.60	0.09	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	960	379	200	1'139 USD	78.02%	782'454.89	0.06	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'601	270	0	1'871 USD	74.34%	1'224'820.01	0.10	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'542	370	150	1'762 USD	74.19%	1'151'040.65	0.09	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	1'570	614	100	2'084 USD	77.70%	1'425'903.69	0.11	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	1'911	773	450	2'234 USD	79.45%	1'562'961.02	0.12	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	2'044	523	150	2'417 USD	77.58%	1'651'086.87	0.13	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	2'170	456	120	2'506 USD	83.05%	1'832'560.87	0.14	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'084	604	280	2'408 USD	77.48%	1'642'951.21	0.13	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	2'193	387	400	2'180 USD	75.59%	1'451'096.87	0.11	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	2'038	709	300	2'447 USD	66.25%	1'427'492.63	0.11	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	1'974	420	200	2'194 USD	68.03%	1'314'313.89	0.10	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	2'251	608	0	2'859 USD	62.25%	1'567'139.05	0.12	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'937	750	710	2'977 USD	50.78%	1'331'178.34	0.11	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	3'043	714	0	3'757 USD	52.48%	1'736'302.09	0.14	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	2'304	470	0	2'774 USD	61.08%	1'491'922.07	0.12	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	1'790	671	0	2'461 USD	61.69%	1'336'788.83	0.11	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	3'141	590	0	3'731 USD	56.16%	1'844'919.28	0.15	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	2'404	450	0	2'854 USD	63.45%	1'594'633.82	0.13	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	3'489	852	175	4'166 USD	59.88%	2'196'437.32	0.17	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	2'981	750	0	3'731 USD	68.89%	2'263'285.62	0.18	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	3'353	733	0	4'086 USD	67.50%	2'428'600.93	0.19	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'500	400	0	2'900 USD	73.00%	1'864'124.35	0.15	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'466	805	300	3'971 USD	61.61%	2'154'273.04	0.17	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.
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	3'359	776	0	4'135 USD	66.58%	2'424'158.78	0.19	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'014	960	0	3'974 USD	59.61%	2'085'914.43	0.16	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	2'947	525	0	3'472 USD	69.20%	2'115'725.95	0.17	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	2'951	729	250	3'430 USD	65.44%	1'976'399.98	0.16	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	2'298	535	0	2'833 USD	73.50%	1'833'529.64	0.14	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	2'692	721	0	3'413 USD	75.34%	2'264'318.64	0.18	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	2'155	445	200	2'400 USD	84.09%	1'777'170.04	0.14	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	2'825	299	0	3'124 USD	77.34%	2'127'601.42	0.17	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	1'903	100	0	2'003 USD	85.50%	1'507'999.11	0.12	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	2'655	725	200	3'180 USD	93.66%	2'622'514.55	0.21	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	1'909	300	0	2'209 USD	93.36%	1'815'965.93	0.14	a)
US912810TN81	3.6250 % T 3 5/8 02/15/53	0	3'094	0	3'094 USD	87.45%	2'382'591.78	0.19	a)
US912810TQ13	3.8750 % T 3 7/8 02/15/43	0	2'290	200	2'090 USD	91.59%	1'685'645.12	0.13	a)
US912810TR95	3.6250 % T 3 5/8 05/15/53	0	3'340	350	2'990 USD	87.53%	2'304'561.71	0.18	a)
US912810TS78	3.8750 % T 3 7/8 08/15/43	0	2'324	200	2'124 USD	91.44%	1'710'144.77	0.14	a)
US912810TT51	4.1250 % T 4 1/8 08/15/53	0	3'400	0	3'400 USD	95.80%	2'868'034.05	0.23	a)
US912810TU25	4.3750 % T 4 3/8 08/15/43	0	2'489	200	2'289 USD	97.94%	1'974'007.64	0.16	a)
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	0	3'447	0	3'447 USD	106.45%	3'231'124.56	0.26	a)
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	0	1'600	0	1'600 USD	102.92%	1'450'045.78	0.11	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	3'160	390	100	3'450 USD	93.03%	2'826'194.02	0.22	a)
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	1'722	60	1'782	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	2'132	300	0	2'432 USD	93.22%	1'996'277.29	0.16	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	1'560	0	1'560	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	1'980	0	1'980	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	2'326	300	0	2'626 USD	92.84%	2'146'848.60	0.17	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	1'050	100	1'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	1'970	250	2'220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	2'110	200	1'200	1'110 USD	97.69%	954'807.88	0.08	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	2'525	889	0	3'414 USD	94.27%	2'833'810.90	0.22	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	1'610	0	0	1'610 USD	97.77%	1'386'009.02	0.11	a)
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	732	300	0	1'032 USD	97.50%	886'009.41	0.07	a)
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	1'240	250	0	1'490 USD	97.64%	1'281'063.98	0.10	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	2'700	931	0	3'631 USD	94.47%	3'020'427.66	0.24	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	950	0	0	950 USD	97.53%	815'870.86	0.06	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'117	540	0	3'657 USD	94.22%	3'034'005.20	0.24	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	950	200	0	1'150 USD	97.00%	982'253.53	0.08	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	950	200	0	1'150 USD	97.30%	985'259.83	0.08	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	850	400	0	1'250 USD	97.19%	1'069'730.66	0.08	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	2'720	554	0	3'274 USD	95.06%	2'740'576.49	0.22	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	1'650	160	0	1'810 USD	96.92%	1'544'736.56	0.12	a)
US9128285P13	2.8750 % T 2 7/8 11/30/23	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	1'300	150	0	1'450 USD	96.41%	1'230'912.59	0.10	a)
US9128285U08	2.6250 % T 2 5/8 12/31/23	1'950	0	1'950	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	1'400	240	0	1'640 USD	96.31%	1'390'850.74	0.11	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	2'841	530	0	3'371 USD	92.64%	2'749'883.07	0.22	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	1'200	250	0	1'450 USD	95.97%	1'225'326.61	0.10	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	1'800	0	1'800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	1'200	100	0	1'300 USD	95.38%	1'091'771.93	0.09	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	2'250	0	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	1'500	50	100	1'450 USD	95.47%	1'218'942.62	0.10	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'347	405	0	2'752 USD	91.22%	2'210'479.89	0.17	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	1'400	270	100	1'570 USD	94.84%	1'311'180.23	0.10	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	1'950	250	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	1'000	250	0	1'250 USD	94.22%	1'037'054.01	0.08	a)
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	2'485	0	2'485	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	2'004	255	2'259	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	3'467	401	3'868	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288J272	2.0000 % T 2 02/15/25	2'588	408	0	2'996 USD	97.09%	2'561'457.21	0.20	a)
US9128288K742	2.0000 % T 2 08/15/25	2'478	674	0	3'152 USD	96.05%	2'665'775.01	0.21	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.
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	2'610	810	0	3'420 USD	95.95%	2'889'609.97	0.23	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	2'740	380	0	3'120 USD	94.39%	2'593'208.60	0.20	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	3'630	200	1'075	2'755 USD	93.86%	2'276'783.72	0.18	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	2'960	340	515	2'785 USD	93.75%	2'299'391.22	0.18	a)
US912828V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	1'700	0	1'700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'130	400	0	2'530 USD	94.00%	2'094'124.01	0.17	a)
US912828W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	1'430	0	1'430	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	3'200	0	3'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	4'025	166	4'191	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	1'410	0	1'410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	2'430	776	0	3'206 USD	93.98%	2'653'219.74	0.21	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	2'525	380	0	2'905 USD	96.72%	2'474'063.45	0.20	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	1'940	525	2'465	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	1'960	100	2'060	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	750	0	0	750 USD	97.30%	642'560.76	0.05	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	920	236	0	1'156 USD	97.31%	990'559.31	0.08	a)
US912828Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	2'000	300	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	1'700	150	0	1'850 USD	93.98%	1'531'022.00	0.12	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	2'100	900	450	2'550 USD	87.48%	1'964'376.46	0.16	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	1'000	150	0	1'150 USD	92.66%	938'267.31	0.07	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	2'000	300	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	1'500	100	400	1'200 USD	93.13%	984'014.63	0.08	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	1'600	400	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	1'000	600	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	1'400	130	0	1'530 USD	92.88%	1'251'250.54	0.10	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	1'450	607	400	1'657 USD	87.69%	1'279'423.19	0.10	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	1'000	150	0	1'150 USD	92.75%	939'216.64	0.07	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	1'500	500	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	1'350	300	0	1'650 USD	92.91%	1'349'841.88	0.11	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	1'150	200	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	1'284	350	0	1'634 USD	96.69%	1'391'157.83	0.11	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	3'614	695	0	4'309 USD	92.05%	3'492'525.52	0.28	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	2'680	600	0	3'280 USD	85.56%	2'471'219.55	0.20	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	600	200	0	800 USD	90.84%	639'939.71	0.05	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	1'300	900	0	2'200 USD	96.20%	1'863'656.46	0.15	a)
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	1'500	350	700	1'150 USD	89.23%	903'616.33	0.07	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	2'000	500	0	2'500 USD	95.30%	2'097'841.69	0.17	a)
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	2'080	350	0	2'430 USD	94.86%	2'029'740.77	0.16	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'900	0	0	1'900 USD	88.58%	1'481'951.81	0.12	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	3'841	680	100	4'421 USD	80.28%	3'125'278.05	0.25	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	1'750	280	300	1'730 USD	88.31%	1'345'309.79	0.11	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	1'868	1'150	0	3'018 USD	94.38%	2'508'015.53	0.20	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	2'000	0	0	2'000 USD	88.06%	1'550'868.69	0.12	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	2'009	650	0	2'659 USD	94.09%	2'203'094.55	0.17	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	2'122	650	0	2'772 USD	93.77%	2'288'710.58	0.18	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	1'916	490	0	2'406 USD	87.39%	1'851'460.56	0.15	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	4'613	1'331	450	5'494 USD	79.61%	3'851'296.18	0.30	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	1'600	537	0	2'137 USD	87.55%	1'647'400.59	0.13	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'287	200	0	2'487 USD	93.45%	2'046'555.90	0.16	a)
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	2'025	735	0	2'760 USD	86.89%	2'111'718.38	0.17	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	2'602	500	0	3'102 USD	93.16%	2'544'531.39	0.20	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	2'500	900	0	3'400 USD	92.86%	2'780'089.12	0.22	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	2'223	600	500	2'323 USD	87.05%	1'780'559.29	0.14	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	5'055	1'517	400	6'172 USD	80.50%	4'374'977.45	0.35	a)
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	2'100	1'137	500	2'737 USD	87.23%	2'102'405.57	0.17	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'500	1'100	800	2'800 USD	92.77%	2'287'173.47	0.18	a)
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	2'400	832	0	3'232 USD	86.98%	2'475'521.18	0.20	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	3'047	250	0	3'297 USD	92.50%	2'685'435.35	0.21	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	3'048	300	0	3'348 USD	92.20%	2'718'223.03	0.21	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.
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	2'804	855	0	3'659 USD	87.20%	2'809'625.62	0.22	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	5'145	700	0	5'845 USD	81.53%	4'196'262.40	0.33	a)
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	2'600	0	2'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'152	300	0	3'452 USD	88.33%	2'684'873.29	0.21	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'217	212	0	3'429 USD	92.19%	2'783'514.86	0.22	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	2'250	0	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	2'338	1'019	302	3'055 USD	88.59%	2'383'008.94	0.19	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	2'890	312	0	3'202 USD	92.45%	2'606'735.22	0.21	a)
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	1'000	2'114	0	3'114 USD	92.16%	2'526'954.51	0.20	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	3'100	324	0	3'424 USD	88.39%	2'664'980.02	0.21	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	4'878	1'150	500	5'528 USD	83.81%	4'079'724.64	0.32	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	900	220	1'120	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	3'000	570	100	3'470 USD	88.19%	2'694'576.56	0.21	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	2'487	800	0	3'287 USD	91.92%	2'660'557.35	0.21	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	2'000	400	2'400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	2'500	1'000	300	3'200 USD	88.02%	2'480'068.93	0.20	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'000	850	0	2'850 USD	92.00%	2'308'802.10	0.18	a)
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	1'100	250	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'000	600	0	2'600 USD	91.16%	2'086'958.53	0.16	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	2'939	400	0	3'339 USD	86.84%	2'553'342.11	0.20	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	5'378	995	0	6'373 USD	80.97%	4'543'759.90	0.36	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	2'000	300	2'300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	2'600	803	300	3'103 USD	87.13%	2'380'557.02	0.19	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	2'665	750	0	3'415 USD	91.20%	2'742'549.19	0.22	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	600	450	1'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	2'955	480	0	3'435 USD	87.44%	2'644'712.67	0.21	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	2'154	1'300	200	3'254 USD	91.31%	2'616'385.92	0.21	a)
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	2'000	1'050	3'050	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	2'700	800	250	3'250 USD	87.80%	2'512'560.14	0.20	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	1'928	976	0	2'904 USD	91.66%	2'343'757.73	0.19	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	1'761	911	2'672	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	5'116	1'366	550	5'932 USD	81.19%	4'240'766.22	0.34	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	2'591	1'000	300	3'291 USD	91.77%	2'659'266.77	0.21	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	2'538	713	0	3'251 USD	88.16%	2'523'620.81	0.20	a)
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	1'982	924	2'906	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	2'781	450	100	3'131 USD	87.42%	2'410'223.02	0.19	a)
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	2'666	250	0	2'916 USD	91.63%	2'352'640.28	0.19	a)
US91282CDR97	0.7500 % T 0 3/4 12/31/23	660	0	660	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	1'670	1'000	2'670	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDV00	0.8750 % T 0 7/8 01/31/24	700	0	700	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	2'184	717	0	2'901 USD	88.88%	2'270'290.15	0.18	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	4'911	940	0	5'851 USD	83.98%	4'326'957.60	0.34	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	2'439	400	0	2'839 USD	96.64%	2'415'900.93	0.19	a)
US91282CEA53	1.5000 % T 1 1/2 02/29/24	800	0	800	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	2'212	503	0	2'715 USD	89.30%	2'134'657.22	0.17	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'200	600	0	2'800 USD	92.91%	2'290'640.76	0.18	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	2'252	0	0	2'252 USD	96.67%	1'917'002.03	0.15	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'241	650	400	2'491 USD	91.38%	2'004'264.98	0.16	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	1'126	634	0	2'760 USD	94.56%	2'298'169.46	0.18	a)
US91282CEG24	2.2500 % T 2 1/4 03/31/24	1'000	0	1'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	2'000	0	0	2'000 USD	97.42%	1'715'696.73	0.14	a)
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	1'800	699	0	2'499 USD	93.56%	2'058'837.62	0.16	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	2'000	775	0	2'775 USD	95.16%	2'325'167.95	0.18	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	4'714	1'084	300	5'498 USD	90.41%	4'376'805.15	0.35	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	2'000	400	0	2'400 USD	97.45%	2'059'496.28	0.16	a)
US91282CER88	2.5000 % T 2 1/2 05/31/24	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CES61	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	1'964	410	0	2'374 USD	92.88%	1'941'482.87	0.15	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	1'693	1'121	300	2'514 USD	94.66%	2'095'407.97	0.17	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	2'205	330	0	2'535 USD	97.47%	2'175'691.83	0.17	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	1'760	492	0	2'252 USD	95.13%	1'886'327.42	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	2'239	360	0	2'599 USD	96.50%	2'208'450.22	0.17	a)
US91282CEX56	3.0000 % T 3 06/30/24	0	201	201	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	2'158	300	0	2'458 USD	97.55%	2'111'296.77	0.17	a)
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	2'249	377	0	2'626 USD	94.86%	2'193'456.50	0.17	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	1'871	300	0	2'171 USD	92.13%	1'761'129.72	0.14	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	2'109	322	0	2'431 USD	97.63%	2'089'777.40	0.17	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	4'496	1'292	200	5'588 USD	89.28%	4'393'095.87	0.35	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	2'115	400	0	2'515 USD	95.97%	2'125'307.86	0.17	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	1'673	142	0	1'815 USD	94.38%	1'508'299.60	0.12	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	1'893	0	0	1'893 USD	98.08%	1'634'845.69	0.13	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	1'750	240	0	1'990 USD	98.02%	1'717'522.32	0.14	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	2'104	200	0	2'304 USD	99.19%	2'012'303.30	0.16	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	1'847	300	0	2'147 USD	99.19%	1'875'180.21	0.15	a)
US91282CFQ96	4.3750 % T 4 3/8 10/31/24	1'980	300	2'280	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	1'670	250	0	1'920 USD	98.58%	1'666'616.90	0.13	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	1'892	500	0	2'392 USD	99.19%	2'089'162.11	0.17	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	4'748	840	200	5'388 USD	98.94%	4'693'994.11	0.37	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	1'487	0	0	1'487 USD	99.61%	1'304'263.16	0.10	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	1'848	350	2'198	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	1'583	480	150	1'913 USD	97.97%	1'650'275.91	0.13	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	2'058	0	0	2'058 USD	98.34%	1'782'157.81	0.14	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	1'481	0	0	1'481 USD	98.78%	1'288'200.90	0.10	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	1'772	183	0	1'955 USD	97.94%	1'685'969.83	0.13	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	2'087	230	0	2'317 USD	98.33%	2'006'124.08	0.16	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	1'744	300	2'044	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	896	970	0	1'866 USD	98.58%	1'619'743.30	0.13	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	1'957	0	0	1'957 USD	99.13%	1'708'158.03	0.13	a)
US91282CGH88	3.5000 % T 3 1/2 01/31/28	0	2'494	0	2'494 USD	97.00%	2'130'208.95	0.17	a)
US91282CGJ45	3.5000 % T 3 1/2 01/31/30	0	1'907	0	1'907 USD	95.95%	1'611'253.28	0.13	a)
US91282CGL90	4.0000 % T 4 02/15/26	0	2'139	0	2'139 USD	98.80%	1'860'835.72	0.15	a)
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	0	5'537	150	5'387 USD	94.34%	4'475'217.34	0.35	a)
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	0	3'000	800	2'200 USD	99.58%	1'929'037.30	0.15	a)
US91282CGP05	4.0000 % T 4 02/29/28	0	2'343	0	2'343 USD	98.78%	2'037'984.27	0.16	a)
US91282CGQ87	4.0000 % T 4 02/28/30	0	2'090	100	1'990 USD	98.52%	1'726'283.79	0.14	a)
US91282CGR60	4.6250 % T 4 5/8 03/15/26	0	2'239	0	2'239 USD	100.00%	1'971'551.45	0.16	a)
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	0	1'993	0	1'993 USD	96.52%	1'693'787.51	0.13	a)
US91282CGT27	3.6250 % T 3 5/8 03/31/28	0	2'395	0	2'395 USD	97.38%	2'053'558.17	0.16	a)
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	0	3'300	1'100	2'200 USD	98.80%	1'913'903.04	0.15	a)
US91282CGV72	3.7500 % T 3 3/4 04/15/26	0	2'549	100	2'449 USD	98.31%	2'120'076.57	0.17	a)
US91282CGX39	3.8750 % T 3 7/8 04/30/25	0	2'390	0	2'390 USD	98.78%	2'078'865.73	0.16	a)
US91282CGZ86	3.5000 % T 3 1/2 04/30/30	0	1'950	0	1'950 USD	95.81%	1'645'170.09	0.13	a)
US91282CHA27	3.5000 % T 3 1/2 04/30/28	0	2'500	300	2'200 USD	96.91%	1'877'277.57	0.15	a)
US91282CHB00	3.6250 % T 3 5/8 05/15/26	0	1'900	0	1'900 USD	98.03%	1'640'106.93	0.13	a)
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	0	5'711	350	5'361 USD	93.31%	4'404'936.52	0.35	a)
US91282CHD65	4.2500 % T 4 1/4 05/31/25	0	2'200	0	2'200 USD	99.17%	1'921'167.58	0.15	a)
US91282CHE49	3.6250 % T 3 5/8 05/31/28	0	2'520	0	2'520 USD	97.34%	2'160'044.18	0.17	a)
US91282CHF14	3.7500 % T 3 3/4 05/31/30	0	1'995	300	1'695 USD	97.09%	1'449'155.53	0.11	a)
US91282CHH79	4.1250 % T 4 1/8 06/15/26	0	2'280	0	2'280 USD	99.06%	1'988'832.24	0.16	a)
US91282CHJ36	3.7500 % T 3 3/4 06/30/30	0	1'970	0	1'970 USD	97.08%	1'683'998.13	0.13	a)
US91282CHK09	4.0000 % T 4 06/30/28	0	2'450	0	2'450 USD	98.80%	2'131'392.02	0.17	a)
US91282CHL81	4.6250 % T 4 5/8 06/30/25	0	2'200	0	2'200 USD	99.67%	1'930'853.63	0.15	a)
US91282CHM64	4.5000 % T 4 1/2 07/15/26	0	2'200	0	2'200 USD	99.92%	1'935'696.65	0.15	a)
US91282CHN48	4.7500 % T 4 3/4 07/31/25	0	2'500	0	2'500 USD	99.88%	2'198'623.28	0.17	a)
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	0	2'540	150	2'390 USD	99.30%	2'089'717.24	0.17	a)
US91282CHR51	4.0000 % T 4 07/31/30	0	1'950	0	1'950 USD	98.45%	1'690'511.45	0.13	a)
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	0	6'085	0	6'085 USD	97.02%	5'198'239.29	0.41	a)
US91282CHU80	4.3750 % T 4 3/8 08/15/26	0	2'000	0	2'000 USD	99.67%	1'755'321.48	0.14	a)
US91282CHV63	5.0000 % T 5 08/31/25	0	2'000	0	2'000 USD	100.27%	1'765'777.83	0.14	a)
US91282CHW47	4.1250 % T 4 1/8 08/31/30	0	2'100	200	1'900 USD	99.11%	1'658'144.53	0.13	a)
US91282CHX20	4.3750 % T 4 3/8 08/31/28	0	2'710	100	2'610 USD	100.31%	2'305'417.49	0.18	a)
US91282CHY03	4.6250 % T 4 5/8 09/15/26	0	2'500	0	2'500 USD	100.28%	2'207'566.37	0.17	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.
US91282CHZ77	4.6250 % T 4 5/8 09/30/30	0	2'144	0	2'144 USD	101.97%	1'925'067.22	0.15	a)
US91282CIA09	4.6250 % T 4 5/8 09/30/28	0	2'762	0	2'762 USD	101.36%	2'465'140.30	0.19	a)
US91282CJB81	5.0000 % T 5 09/30/25	0	2'706	0	2'706 USD	100.31%	2'390'214.45	0.19	a)
US91282CJC64	4.6250 % T 4 5/8 10/15/26	0	2'500	0	2'500 USD	100.33%	2'208'598.15	0.17	a)
US91282CJE21	5.0000 % T 5 10/31/25	0	2'800	0	2'800 USD	100.39%	2'475'170.89	0.20	a)
US91282CJF95	4.8750 % T 4 7/8 10/31/28	0	3'000	450	2'550 USD	102.44%	2'300'134.19	0.18	a)
US91282CJG78	4.8750 % T 4 7/8 10/31/30	0	2'100	0	2'100 USD	103.41%	1'912'141.84	0.15	a)
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	0	6'101	200	5'901 USD	101.91%	5'295'176.69	0.42	a)
US91282CJL80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	0	2'800	0	2'800 USD	100.38%	2'474'785.78	0.20	a)
US91282CJL63	4.8750 % T 4 7/8 11/30/25	0	550	0	550 USD	100.25%	485'513.26	0.04	a)
US91282CJM47	4.3750 % T 4 3/8 11/30/30	0	2'320	0	2'320 USD	100.55%	2'054'048.08	0.16	a)
US91282CJN20	4.3750 % T 4 3/8 11/30/28	0	3'162	200	2'962 USD	100.42%	2'619'192.53	0.21	a)
US91282CJP77	4.3750 % T 4 3/8 12/15/26	0	2'100	0	2'100 USD	99.80%	1'845'399.00	0.15	a)
US91282CJQ50	3.7500 % T 3 3/4 12/31/30	0	1'300	0	1'300 USD	96.92%	1'109'479.30	0.09	a)
US91282CJR34	3.7500 % T 3 3/4 12/31/28	0	1'500	0	1'500 USD	97.72%	1'290'693.68	0.10	a)
US91282CJS17	4.2500 % T 4 1/4 12/31/25	0	3'150	0	3'150 USD	99.22%	2'752'062.72	0.22	a)
US91282CJT99	4.0000 % T 4 01/15/27	0	700	0	700 USD	98.83%	609'161.71	0.05	a)
US91282CJV46	4.2500 % T 4 1/4 01/31/26	0	1'200	0	1'200 USD	99.27%	1'048'900.10	0.08	a)
US91282CJW29	4.0000 % T 4 01/31/29	0	3'600	350	3'250 USD	98.84%	2'828'698.09	0.22	a)
<b>USD</b>							<b>523'261'234.89</b>	<b>41.34</b>	

### Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

							<b>591'274'267.63</b>	<b>46.71</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>591'274'267.63</b>	<b>46.71</b>	
CH0302469082	SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVT. ST	218	60	26	251 AUD	105'010.72	15'126'320.13	1.19	a)
<b>AUD</b>							<b>15'126'320.13</b>	<b>1.19</b>	
CH0302468589	SWC (CH) INDEX BF CANADA GOVT. ST	268	110	26	351 CAD	99'115.01	22'592'144.04	1.78	a)
<b>CAD</b>							<b>22'592'144.04</b>	<b>1.78</b>	
CH0302469108	SWC (CH) INDEX BF WORLD REST GOVT. ST CHF	363	121	39	445 CHF	89'581.72	39'854'460.57	3.15	a)
<b>CHF</b>							<b>39'854'460.57</b>	<b>3.15</b>	
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	272'675	478'622	33'354	717'943 CNY	1'101.46	96'641'582.61	7.63	a)
<b>CNY</b>							<b>96'641'582.61</b>	<b>7.63</b>	
CH0117045150	SWC (CH) INDEX BF EMU GOVT. NT EUR	0	3'430'678	208'620	3'222'059 EUR	116.82	358'660'003.21	28.33	a)
CH0302432049	SWC (CH) INDEX BF AUSTRIA GOVT. ST EUR	126	38	165	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432064	SWC (CH) INDEX BF BELGIUM GOVT. ST EUR	193	44	237	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432072	SWC (CH) INDEX BF FINLAND GOVT. ST EUR	53	15	68	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432098	SWC (CH) INDEX BF FRANCE GOVT. ST EUR	866	288	1'155	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432130	SWC (CH) INDEX BF GERMANY GOVT. ST EUR	666	210	876	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432148	SWC (CH) INDEX BF IRELAND GOVT. ST EUR	65	16	81	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432163	SWC (CH) INDEX BF ITALY GOVT. ST EUR	720	228	948	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432171	SWC (CH) INDEX BF NETHERLANDS GOVT. ST EUR	157	47	204	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH0302432254	SWC (CH) INDEX BF SPAIN GOVT. ST EUR	478	143	621	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>EUR</b>							<b>358'660'003.21</b>	<b>28.33</b>	
CH0302468605	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. ST GBP	432	241	62	610 GBP	85'901.86	58'399'757.07	4.61	a)
<b>GBP</b>							<b>58'399'757.07</b>	<b>4.61</b>	

### Derivative Finanzinstrumente

**3'198.93 0.00**

### Devisentermingeschäfte

CNY/CHF	Verfall 03.03.2023	38'170'638	281'115'000		CHF/CNY	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall 03.03.2023	4'118'216	19'561'000		CHF/PLN	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.03.2023	432'041'471	471'781'000		CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.03.2023	293'010'990	294'054'000		CHF/EUR	0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall 03.03.2023	7'490'678	154'607'000		CHF/MXN	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 03.03.2023	1'783'860	20'363'000		CHF/SEK	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 03.03.2023	4'167'491	5'978'000		CHF/SGD	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.
	JPY/CHF Verfall 03.03.2023		140'051'144	19'807'309'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.03.2023		18'261'337	26'603'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.03.2023		42'970'662	38'090'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.03.2023		1'807'962	19'695'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.03.2023		2'924'297	21'828'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.03.2023		2'048'306	3'460'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.03.2023		14'767'479	22'858'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		610'668	670'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.03.2023		11'000	6'461		NZD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.03.2023		16'440	340'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.03.2023		35'000	24'332		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.03.2023		115'000	24'258		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.03.2023		1'027'000	1'024'337		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.03.2023		75'000	10'056		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.03.2023		36'000	40'474		GBP/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.03.2023		5'165	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.03.2023		44'000	30'111		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.03.2023		56'327'000	398'764		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		2'963'431	3'266'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		2'088'585	2'101'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.03.2023		1'496'628	212'556'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.03.2023		400'002	359'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.03.2023		199'297	1'473'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		2'017'114	2'187'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		1'398'809	1'419'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.03.2023		1'433'504	208'540'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.03.2023		205'502	183'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		1'421'631	1'537'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.03.2023		397'487	2'956'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		1'108'224	1'121'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.03.2023		5'943'000	4'129'618		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.03.2023		478'650'000	448'935'408		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.03.2023		20'162'000'000	138'228'656		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.03.2023		154'947'000	7'904'528		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.03.2023		19'695'000	1'786'455		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.03.2023		22'866'000	14'395'908		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.03.2023		285'544'000	38'477'054		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.03.2023		297'668'000	296'272'830		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.03.2023		38'596'000	43'651'188		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.03.2023		21'753'000	2'908'963		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.03.2023		26'559'000	18'324'462		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.03.2023		20'363'000	1'834'625		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.03.2023		19'446'000	4'100'092		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.03.2023		3'449'000	1'986'586		NZD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.03.2023		3'106'014	11'714'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.03.2023		21'130	80'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.03.2023		11'794'000	3'005'748		ILS/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.04.2023		3'796'621	5'480'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.04.2023		433'323'441	463'695'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.04.2023		139'740'250	20'362'789'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.04.2023		7'699'055	152'436'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.04.2023		1'788'672	19'758'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.04.2023		14'117'504	22'482'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.04.2023		290'686'694	292'547'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.04.2023		2'931'505	11'534'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.04.2023		42'164'209	37'395'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.04.2023		2'836'839	21'244'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.04.2023		17'802'767	25'890'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.04.2023		1'842'910	20'495'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.04.2023		3'988'879	19'033'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.04.2023		1'941'517	3'383'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.04.2023		10'359	202'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.04.2023		168'000	43'546		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2023		1'240'000	1'394'597		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2023		1'315'000	1'230'823		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.04.2023		137'925'000	952'768		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.04.2023		82'595	120'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.04.2023		14'927	70'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.04.2023		20'000	13'963		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.04.2023		185'000	24'892		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2023		2'952'000	2'954'760		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.04.2023		34'000	21'555		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.04.2023		362'000	247'467		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2023		2'271'000	2'258'117		EUR/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CHF/JPY	Verfall 05.04.2023		114'201'000	785'910		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.04.2023		710'000	440'331		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.04.2023		2'823'000	2'647'460		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.04.2023		268'000	298'590		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 05.04.2023		152'638'000	7'720'491		MXN/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.04.2023		287'324'000	285'154'704		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 05.04.2023		20'495'000	1'805'548		SEK/CHF	0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 05.04.2023		21'059'000	2'805'838		DKK/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.04.2023		35'887'000	40'532'787		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 05.04.2023		19'758'000	1'723'411		NOK/CHF	0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 05.04.2023		11'366'000	2'883'566		ILS/CHF	0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 05.04.2023		19'103'000	4'050'314		PLN/CHF	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.04.2023		21'738'000	13'299'526		AUD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.04.2023		459'557'000	419'783'720		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 05.04.2023		3'383'000	1'933'418		NZD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.04.2023		20'110'663'000	138'048'842		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 05.04.2023		5'460'000	3'751'413		SGD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 05.04.2023		25'648'000	17'311'759		CAD/CHF	0.00	0.00	
CNY/CHF	Verfall 06.04.2023		38'446'052	285'823'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 06.04.2023		285'823'000	38'021'605		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.07.2023		7'363'688	6'600'000		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.07.2023		306'226'882	1'900'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.08.2023		2'689'006	2'570'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 04.08.2023		44'498'649	5'400'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.08.2023		8'883'279	7'700'000		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.08.2023		401'526'127	2'450'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.08.2023		1'093'927	1'220'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.08.2023		460'000	521'532		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.09.2023		3'400'000	3'547'239		CHF/EUR	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.09.2023		8'500'000	9'625'021		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 06.09.2023		6'988'465	850'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
JPY/CNY	Verfall 06.09.2023		1'791'936	36'000'000		CNY/JPY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.10.2023		940'000	842'009		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.10.2023		6'950'000	7'176'512		CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.10.2023		4'240'000	691'644'156		CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.10.2023		10'250'000	11'206'436		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 03.11.2023		33'073'318	4'100'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.11.2023		6'485'469	5'900'000		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.12.2023		1'362'695	1'500'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.12.2023		4'606'114	4'370'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.12.2023		3'588'265	3'120'000		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.12.2023		54'362'554	6'620'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.12.2023		322'989'180	1'900'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.12.2023		5'000'000	610'675		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.12.2023		2'600'000	2'473'926		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.12.2023		550'000	606'522		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.12.2023		4'260'000	3'718'345		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.12.2023		200'000'000	1'180'766		JPY/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.12.2023		900'000	1'045'698		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.12.2023		550'000	91'755'823		CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.12.2023		3'100'000	3'618'291		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 28.12.2023		900'000	149'326'537		CHF/JPY	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2024		3'011'757	2'800'000		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 05.01.2024		1'206'377	770'000		CAD/CHF	0.00	0.00	
CHF/CNY	Verfall 05.01.2024		46'273'581	5'470'000		CNY/CHF	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2024		1'659'067	1'780'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.01.2024		13'426'774	11'300'000		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.02.2024		5'830'000	6'798'612		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.02.2024		6'950'000	7'460'604		CHF/EUR	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.02.2024		500'000	778'986		CHF/CAD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.02.2024		4'470'000	761'602'944		CHF/JPY	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.03.2024		1'260'000	1'131'388		CHF/GBP	465.34	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 05.03.2024		1'260'000	1'322'439		CHF/EUR	304.78	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		6'300'000	7'155'724		CHF/USD	2'428.82	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>3'198.94</b>	<b>0.00</b>	
<b>Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)</b>									
PLN/CHF	Verfall 03.05.2023		4'097'706	19'424'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 03.05.2023		137'634'867	20'027'424'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.05.2023		87'799'000	606'364		JPY/CHF	0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 03.05.2023		268'000	57'051		PLN/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		4'756'591	711'266'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.05.2023		19'156'000	4'108'560		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		20'650'891'000	134'996'940		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.05.2023		353'310'000	45'418'001		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		288'889'729	291'531'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		423'771'528	465'392'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.05.2023		1'502'638	17'259'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.05.2023		1'861'919	21'169'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.05.2023		2'886'514	21'693'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.05.2023		7'880'399	157'198'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.05.2023		3'929'143	5'732'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.05.2023		17'672'346	26'255'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.05.2023		13'814'530	22'628'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.05.2023		41'976'930	37'260'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.05.2023		2'917'413	11'530'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.05.2023		2'128'478	3'736'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.05.2023		32'000	19'771		AUD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.05.2023		41'927	837'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.05.2023		25'819	102'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.05.2023		240'000	270'913		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.05.2023		33'825	50'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.05.2023		50'000	49'620		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		6'065'790	6'667'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.05.2023		11'000	6'298		NZD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.05.2023		6'676'251	6'762'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		7'721'399	8'612'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.05.2023		158'035'000	7'794'349		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.05.2023		11'632'000	2'847'141		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.05.2023		22'596'000	13'288'753		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.05.2023		480'671'000	427'741'913		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.05.2023		3'725'000	2'047'409		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.05.2023		17'259'000	1'436'915		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.05.2023		21'693'000	2'859'929		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.05.2023		21'169'000	1'836'940		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.05.2023		37'020'000	41'414'089		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.05.2023		298'243'000	293'078'326		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.05.2023		26'305'000	17'259'552		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.05.2023		5'732'000	3'823'456		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		38'167'534	287'205'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		2'803'017	21'159'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		2'766'022	21'005'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		1'484'880	11'568'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.05.2023		1'598'876	12'373'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		6'022'000	4'062'863		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		10'732'000	2'626'131		ILS/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		7'913'728	162'132'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2023		4'141'665	19'418'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		2'556'912	10'477'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		13'286'841	22'645'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		428'192'091	482'957'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2023		2'090'374	3'818'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		134'417'168	20'542'938'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2023		1'401'543	16'870'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		45'613'668	355'266'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.06.2023		2'783'653	21'149'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		1'802'995	20'821'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		40'606'451	36'406'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		291'059'416	296'739'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		17'294'616	26'440'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		3'929'821	5'907'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		11'251'647	11'479'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		5'780'938	881'293'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2023		69'000	41'017		AUD/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2023		10'883	132'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2023		20'069	94'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		35'661	277'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.06.2023		18'000	12'029		SGD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.06.2023		2'968'889	2'672'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.06.2023		25'120	191'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		25'101	511'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		14'375'564	16'132'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		25'847	299'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		1'143'239	1'747'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.06.2023		869'832	1'460'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 05.06.2023		340'000	330'931		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		2'303'478	2'574'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		95'000	106'083		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.06.2023		138'943	210'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		985'875	7'740'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.06.2023		997'264	153'443'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		1'805'127	1'862'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2023		19'310	234'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2023		67'877	123'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.06.2023		1'725'143	1'773'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		173'452	3'431'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2023		109'595	508'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2023		82'179	338'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2023		8'000	7'230		USD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.06.2023		4'991	39'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.06.2023		67'407	516'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.06.2023		52'452	622'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		105'167	157'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2023		83'000	20'151		ILS/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.06.2023		3'660	17'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2023		32'000	17'525		NZD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.06.2023		26'348	520'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2023		4'000	2'356		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2023		38'000	4'852		CNY/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.06.2023		2'345	18'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2023		213'000	17'811		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2023		5'000	4'854		EUR/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.06.2023		20'572	251'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.06.2023		24'000	16'033		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.06.2023		28'397'000	19'094'143		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.06.2023		21'577'674'000	141'209'909		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.06.2023		3'909'000	2'140'920		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.06.2023		17'487'000	1'434'231		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.06.2023		21'874'000	2'862'432		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.06.2023		24'032'000	14'215'192		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.06.2023		166'594'000	8'566'830		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.06.2023		38'983'000	44'159'514		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2023		501'655'000	458'623'034		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.06.2023		20'037'000	4'304'138		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.06.2023		21'529'000	1'807'726		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.06.2023		363'284'000	46'603'161		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.06.2023		311'508'000	303'556'291		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		18'468'647	27'545'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		141'144'367	21'542'312'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.07.2023		2'115'098	3'876'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.07.2023		1'434'965	17'534'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.07.2023		4'075'755	6'057'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2023		2'841'811	21'749'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		13'866'293	23'500'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2023		8'610'178	169'174'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		41'523'320	36'764'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		447'184'088	491'097'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.07.2023		4'299'706	20'125'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		1'806'793	21'560'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		46'830'884	365'458'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.07.2023		2'668'611	10'932'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		298'417'342	306'789'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2023		177'116	264'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		3'792'764	3'896'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2023		193'176	3'770'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2023		59'099	452'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		91'409	716'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		4'646'387	5'131'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		690'889	609'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.07.2023		22'029	91'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.07.2023		323'000	177'185		NZD/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.07.2023		27'448	128'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.07.2023		7'835	96'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2023		107'585	181'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.07.2023		84'005	125'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2023		20'382	244'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2023		30'333	4'632'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2023		4'457'957	35'601'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2023		2'023'568	1'778'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		9'951'873	11'146'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2023		4'550'138	4'667'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		3'973'000	496'859		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		39'151'000	44'522'909		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.07.2023		22'201'000	2'910'462		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.07.2023		21'804'000	1'806'156		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.07.2023		3'553'000	1'947'392		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.07.2023		17'630'000	1'472'369		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.07.2023		20'253'000	4'458'698		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.07.2023		11'023'000	2'657'171		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		315'352'000	307'757'062		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2023		172'944'000	9'018'424		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2023		27'809'000	18'801'581		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.07.2023		6'182'000	4'086'840		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		507'374'000	453'914'538		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2023		397'802'000	48'917'314		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2023		23'681'000	14'102'770		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2023		21'546'944'000	133'370'197		JPY/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		2'896'019	22'119'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		44'445'575	39'190'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2023		1'781'189	21'539'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.08.2023		1'927'682	3'528'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		1'449'675	17'392'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		4'587'144	20'930'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		307'945'083	316'033'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2023		9'037'213	174'823'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		18'740'353	27'790'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2023		4'069'566	6'168'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		451'423'822	506'093'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		13'867'535	23'336'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		49'047'432	399'201'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		134'295'261	21'667'026'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2023		123'261	186'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		1'566'188	252'067'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		42'336	323'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		4'191'850	33'927'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		179'655	820'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2023		208'233	4'000'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		1'121'586	989'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		4'212'360	4'714'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		25'075	300'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.08.2023		77'601	141'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		3'800'252	3'894'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.08.2023		49'000	33'101		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		352'640	590'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2023		66'363	805'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.08.2023		297'000	15'549		MXN/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		18'588	142'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2023		171'000	14'079		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.08.2023		32'000	21'200		SGD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.08.2023		9'972	18'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		10'680	49'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		18'417	219'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		347'946	521'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		1'998'251	2'053'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		753'905	120'313'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		2'237'556	2'520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2023		23'582	278'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		3'674'449	585'121'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2023		1'366'907	1'204'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2023		221'000	4'308'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		11'007'886	12'507'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2023		64'549	782'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2023		1'483'697	12'150'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2023		70'049	538'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.08.2023		31'012	57'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2023		107'610	164'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2023		73'707	339'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		7'347'734	7'588'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2023		502'959	758'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		1'095'770	1'140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2023		504'399	81'872'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		1'492'697	1'739'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2023		301'038	513'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 04.08.2023		586'294	608'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.08.2023		18'189'000	1'558'715		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.08.2023		41'383'000	46'147'342		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.08.2023		22'138'000	4'803'127		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.08.2023		29'020'000	19'111'179		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2023		22'706'399'000	138'534'465		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.08.2023		3'744'000	2'019'544		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.08.2023		23'122'000	2'965'535		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.08.2023		182'834'000	9'486'031		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		527'573'000	457'256'488		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2023		22'955'000	1'893'466		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.08.2023		24'439'000	14'273'891		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2023		445'278'000	54'030'923		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.08.2023		6'486'000	4'233'976		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2023		331'316'000	316'619'982		EUR/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.08.2023		2'669'479	11'104'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.08.2023		118'230	489'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 07.08.2023		75'233	315'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 07.08.2023		11'908'000	2'817'159		ILS/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2023		1'549'825	18'130'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		4'833'222	22'395'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		47'431'051	42'679'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		2'811'711	11'916'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		18'830'501	28'684'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		139'456'727	22'822'474'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		2'076'927	3'864'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		2'955'209	23'080'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		9'461'154	184'120'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		461'263'169	534'087'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2023		1'903'074	23'118'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		14'298'274	24'541'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		59'169'192	487'937'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2023		4'228'530	6'491'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		318'289'263	333'717'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		165'201	1'286'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2023		34'555	424'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		381'172	7'481'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		1'645'050	1'719'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		798'503	1'218'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		2'641'638	3'021'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2023		227'000	27'626		CNY/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2023		28'204	332'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		690'080	622'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		112'174	211'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		123'690	519'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		194'652'000	1'193'369		JPY/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		77'724	363'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		15'460	27'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2023		118'049	181'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.09.2023		135'000	6'852		MXN/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		17'464	81'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2023		229'000	27'778		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.09.2023		11'000	6'305		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		1'953	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		330'380	380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		591'883	96'109'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		4'436	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		59'000	56'622		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		242'087	252'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		410'584	3'384'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.09.2023		52'000	57'915		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.09.2023		16'000	9'172		AUD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		433'330	497'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2023		106'000	23'026		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.09.2023		36'000	23'473		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		18'506'000	113'853		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		23'072	24'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		217'381	380'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		33'992	39'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		225'839	37'279'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		4'788	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		199'176	227'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		208'888	188'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		364'008	415'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		228'648	37'896'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		109'698	169'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		352'399	368'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2023		12'206	95'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.09.2023		22'000	5'106	ILS/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2023		20'127	31'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		8'798	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		334'134	349'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2023		41'000	8'785	PLN/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2023		18'369	222'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2023		84'000	17'919	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.09.2023		87'000	6'994	SEK/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2023		16'960	327'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.09.2023		15'000	7'834	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.09.2023		46'000	10'672	ILS/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		15'807	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2023		121'989	128'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		227'163	37'370'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2023		64'000	13'651	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		514'000	452'978	USD/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		23'511	45'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.09.2023		66'000	5'298	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.09.2023		69'000	8'849	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.09.2023		277'000	14'523	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		22'000	21'027	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		1'582'000	9'589	JPY/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2023		28'092	121'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2023		23'301	194'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.09.2023		24'000	15'591	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.09.2023		87'000	11'183	DKK/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2023		36'646	171'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2023		7'124	11'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.09.2023		44'000	10'198	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.09.2023		84'000	6'806	SEK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2023		54'295	9'030'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		332'000	318'012	EUR/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2023		7'970	14'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 06.09.2023		16'240	31'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.09.2023		67'000	5'560	NOK/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2023		18'960	17'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		545'000	477'557	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		336'149'000	322'230'751	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2023		22'825'418'000	138'494'365	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.09.2023		191'516'000	10'047'772	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.09.2023		23'305'000	1'879'921	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.09.2023		18'617'000	1'545'863	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 06.09.2023		4'136'000	2'175'164	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2023		22'715'000	4'867'257	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.09.2023		24'305'000	3'126'231	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.09.2023		6'679'000	4'368'200	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.09.2023		30'049'000	19'615'266	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		537'635'000	474'837'081	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.09.2023		24'935'000	14'262'147	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.09.2023		43'458'000	48'636'021	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.09.2023		12'444'000	2'893'585	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2023		491'059'000	59'584'608	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 02.10.2023		162'000	20'346	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		29'040'000	19'648'522	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.10.2023		522'891'000	65'659'423	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		24'451'000	14'436'848	AUD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		318'553'261	332'878'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		136'377'407	22'444'781'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.10.2023		9'830'260	188'884'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		1'838'903	22'835'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.10.2023		1'529'282	18'458'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.10.2023		2'149'774	4'100'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.10.2023		4'880'959	22'885'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.10.2023		3'091'037	24'066'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		4'281'194	6'558'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		19'562'149	30'048'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		461'473'446	524'111'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.10.2023		14'294'920	25'043'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		48'017'346	43'031'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.10.2023		2'916'529	12'570'000	CHF/ILS		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		286'984	258'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.10.2023		21'000	4'469		PLN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		854'905	970'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.10.2023		13'465	263'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		1'647'299	1'727'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		8'492	13'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.10.2023		3'950	17'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.10.2023		47'280	83'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.10.2023		8'397	16'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		41'827'000	253'649		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		12'985	20'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.10.2023		18'050	141'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.10.2023		4'062	49'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		5'685	71'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.10.2023		136'000	88'462		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		364'000	322'728		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.10.2023		314'000	177'641		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		159'000	177'000		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		11'920	1'977'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		303'000	288'050		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.10.2023		9'000	5'881		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.10.2023		880'000	573'764		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		8'419'000	7'498'105		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.10.2023		282'000	14'225		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		724'000	805'474		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.10.2023		358'000	203'473		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.10.2023		34'000	7'089		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		483'326'000	2'927'709		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		6'085'000	5'810'250		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		13'360	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.10.2023		20'000	4'639		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		3'000	3'334		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.10.2023		3'000	1'956		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.10.2023		39'000	4'993		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.10.2023		29'000	2'413		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.10.2023		37'000	2'962		SEK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		558'437	585'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.10.2023		3'000	1'705		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.10.2023		6'000	3'144		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.10.2023		24'000	1'214		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		743'000	4'516		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		20'000	17'794		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		32'445	34'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		6'436	1'056'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		492'770	554'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		18'000	17'222		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		27'702	29'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		25'000	22'272		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		30'291	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		22'000	21'069		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		378'309	395'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		876'879	978'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		835'203	871'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		281'312	253'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		13'414	14'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		241'230	270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		184'974	30'517'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		15'735	2'571'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		610'022	674'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		314'580	326'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		5'566	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		189'837	208'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		187'345	194'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		7'568'000	46'476		JPY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		19'333	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		27'391	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		125'279'000	768'657		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		176'000	196'712		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.10.2023		9'000	6'111		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		1'061'000	1'027'135		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		1'677'000	1'536'828		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.10.2023		6'562'000	4'398'108		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.10.2023		4'110'000	2'258'963		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.10.2023		21'822'159'000	133'791'220		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 04.10.2023		24'168'000	3'139'037		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.10.2023		12'567'000	3'020'051		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.10.2023		18'478'000	1'588'665		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.10.2023		188'841'000	9'938'777		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.10.2023		22'869'000	1'925'730		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.10.2023		329'584'000	319'215'287		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.10.2023		517'339'000	473'239'472		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.10.2023		22'830'000	4'784'346		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		42'485'000	47'434'672		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		59'922'733	495'041'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		987'061	8'134'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		2'263'810	18'644'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		3'641'000	443'543		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 10.10.2023		47'000	5'707		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		7'439	60'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 10.10.2023		606'758	4'862'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.11.2023		166'757'000	8'406'621		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 02.11.2023		22'719'000	4'906'622		PLN/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2023		4'029'206	6'023'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.11.2023		2'182'750	3'984'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		18'764'415	27'811'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.11.2023		2'931'816	22'610'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		65'069'492	519'235'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2023		1'553'191	18'109'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		8'680'754	166'319'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2023		1'867'050	22'217'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		300'186'947	310'550'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		450'940'056	494'544'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		13'766'004	23'365'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2023		4'733'198	22'679'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		45'321'210	40'715'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2023		11'644	140'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		48'962	73'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2023		22'731	438'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.11.2023		16'000	8'730		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		182'000	22'827		CNY/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2023		8'337	40'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		2'441'040	2'535'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2023		16'030	24'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		1'067'000	977'705		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		22'000	12'858		AUD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.11.2023		28'936	224'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2023		7'033	83'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		423'182	381'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		594'357	617'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		5'795	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		5'527	44'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		852'228	928'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		35'500	32'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		6'367	11'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		27'918	29'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		357'433	390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		634'414	5'063'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		1'560	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		5'544	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		11'531	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		19'146	21'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		7'000	4'653		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		330'674	345'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		403'908	447'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		10'000	11'078		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		5'000	2'900		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		138'000	17'114		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		175'194	183'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		171'978	191'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		16'244	17'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		335'639	371'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		4'088	33'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		111'485	124'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		326'368	343'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		186'863	197'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.11.2023		9'277	73'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		308'649	346'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2023		9'317	116'000		CHF/NOK	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.
	SGD/CHF Verfall 03.11.2023		5'212	8'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2023		34'690	284'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2023		6'800	12'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2023		9'734	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2023		2'751'039	3'076'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2023		205'281	189'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2023		2'097'758	2'215'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.11.2023		22'907'000	2'951'911	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.11.2023		18'308'000	1'491'095	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2023		499'371'000	454'398'147	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2023		23'371'000	13'466'207	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.11.2023		3'968'000	2'100'072	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.11.2023		6'055'000	4'021'683	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2023		27'895'000	18'283'666	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2023		524'339'000	64'990'246	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2023		22'357'000	1'820'653	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2023		317'043'000	304'976'343	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2023		41'312'000	45'618'941	GBP/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		128'931'985	20'993'395'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.11.2023		2'918'956	12'175'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.11.2023		5'490	23'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		45'808'000	281'514	JPY/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		11'043	1'784'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		12'022	1'945'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		4'952	804'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		326'260	53'544'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		279'132	46'061'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		2'271	381'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.11.2023		758'656	127'017'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.11.2023		12'198'000	2'743'574	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.11.2023		21'179'123'000	127'300'296	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		12'022'000	2'806'860	ILS/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.12.2023		2'978'358	23'155'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		8'295'120	166'004'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.12.2023		1'607'331	19'784'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		2'689'305	11'984'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		453'263'409	499'840'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		13'185'451	22'938'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		124'829'276	20'737'896'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.12.2023		2'108'425	3'997'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2023		4'065'787	6'134'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		18'324'000	28'040'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		68'761'133	555'457'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.12.2023		1'827'921	22'495'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		4'733'295	22'001'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		303'967'703	316'667'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		44'956'094	40'843'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2023		120'000	69'348	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.12.2023		63'000	5'096	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.12.2023		17'000	8'992	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		590'000	73'119	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		105'621'000	637'880	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		162'818	148'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		171'000	163'710	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		54'000	35'309	CAD/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		7'278	34'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		1'574'000	1'428'186	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.12.2023		8'000	5'304	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2023		76'000	3'825	MXN/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		5'881	26'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		3'926	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		2'911	5'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		2'031	40'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		72'162	75'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		29'626	4'938'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		106'455	119'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		9'978	9'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		16'261	132'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2023		3'980	6'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		4'947	23'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		1'039'939	173'594'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		6'787	133'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		4'077'600	4'541'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		1'441'292	1'305'000	CHF/GBP		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		379'769	658'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2023		2'780	12'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.12.2023		2'129	4'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		3'568'757	3'716'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		15'024	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		429'361	3'477'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.12.2023		3'091	24'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		344'004	357'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		321'177	492'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		462'915	514'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		116'349	19'535'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		574'189	648'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		5'534'502	5'740'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		2'293'961	386'101'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2023		13'750	269'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2023		286'305	491'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2023		7'787	35'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		869'551	781'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2023		204'859	317'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2023		5'933	9'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		7'739'796	8'816'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		1'589'627	12'930'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2023		840'042	875'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2023		9'995	9'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2023		201'492	1'644'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2023		335'861	56'566'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2023		1'165'001	1'332'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.12.2023		19'721'000	1'590'597	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.12.2023		6'141'000	4'000'745	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.12.2023		22'495'000	1'866'309	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2023		43'095'000	47'432'081	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2023		28'824'000	18'483'361	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.12.2023		22'093'000	4'813'777	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2023		514'236'000	447'087'577	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.12.2023		3'984'000	2'139'400	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2023		573'050'000	69'777'433	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2023		166'370'000	8'325'255	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2023		23'972'000	13'819'738	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2023		21'273'009'000	125'126'775	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2023		327'259'000	310'450'651	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.12.2023		23'179'000	2'949'875	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		22'293'331'000	133'084'498	JPY/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2024		1'639'388	20'380'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		4'109'856	6'322'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		1'948'141	23'526'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		50'669'021	46'188'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		19'170'969	29'988'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2024		4'939'706	22'780'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		465'376'065	537'204'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.01.2024		2'290'506	4'280'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		76'132'606	626'142'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		8'878'481	178'967'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		14'368'400	24'987'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		130'947'821	22'229'699'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		324'232'577	342'515'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.01.2024		2'651'120	20'872'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		637'114	5'224'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		2'417'379	2'546'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		589'135	536'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		3'638'089	4'183'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		8'628	15'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		10'891	17'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		1'164'536	196'949'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		74'000	42'739	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		45'598	374'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		2'098'000	1'824'110	USD/CHF		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2024		194'089	891'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2024		90'880	1'119'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		70'539	846'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.01.2024		88'053	164'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		23'437'000	138'702	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		55'000	35'393	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		976'000	920'695	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		348'000	382'310	GBP/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		279'488	5'585'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.01.2024		58'843	465'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		136'083	209'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		6'622'000	809'791		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		1'729'000	1'511'371		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		12'000	2'608		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		359'000	207'017		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		528'000	339'441		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		773'000	729'543		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		11'683'000	71'209		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		95'000	4'743		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024		3'000	1'960		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		251'000	275'948		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		11'000	7'115		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		1'677'000	1'582'139		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		234'000	28'567		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		17'000	18'718		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		120'573'000	725'073		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		2'444'000	2'143'459		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		9'000	5'186		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		1'385'000	8'345		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		19'000	17'927		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		24'000	20'982		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		331'000	365'152		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.01.2024		43'000	23'064		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2024		237'000	20'101		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.01.2024		209'000	17'277		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		445'000	423'269		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		4'486'000	27'452		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		230'000	50'597		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		709'000	410'887		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024		63'000	41'095		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		363'000	313'762		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		125'000	15'212		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2024		208'000	26'542		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		5'741'000	286'405		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		686'040	1'060'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		1'264'506	10'406'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		4'364'578	4'618'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		716'460	652'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		5'617'021	6'492'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		18'619	32'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2024		6'333	29'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		12'094	241'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		1'917'030	313'167'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		4'552	7'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		4'256'000	25'841		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		82'000	77'605		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		4'000	4'382		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		12'128	14'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		428'000	403'928		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		19'159'000	114'651		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		71'772	595'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		51'395	47'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024		17'000	10'992		SGD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2024		96'569	1'923'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		18'019	28'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		39'000	8'484		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		642'000	551'020		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		12'197	21'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		715'000	675'099		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		80'000	9'641		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		89'289'000	535'609		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		971'000	834'861		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		9'000	9'805		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		21'000	13'509		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		7'845'000	940'906		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		3'508'000	3'002'627		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		1'974'000	1'857'917		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		295'000	319'582		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		16'000	9'298		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		125'000	6'269		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		144'892'000	873'832		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		219'000	10'856		MXN/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		36'216	39'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2024		8'581	73'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		5'339	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		27'324'000	162'200		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		51'846	62'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2024		342'629'000	318'504'492		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.01.2024		4'401'000	2'344'919		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2024		23'888'000	13'717'923		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2024		536'176'000	451'203'900		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2024		46'173'000	49'534'025		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2024		23'419'000	5'011'830		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2024		180'536'000	8'970'978		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2024		24'135'000	2'015'200		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2024		627'908'000	74'212'447		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.01.2024		21'290'000	1'764'015		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2024		21'129'000	2'634'955		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2024		30'478'000	19'451'517		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2024		6'455'000	4'118'290		SGD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.01.2024		2'917'702	12'534'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.01.2024		61'786	264'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.01.2024		124'000	29'240		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.01.2024		23'000	5'454		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.01.2024		12'651'000	2'956'286		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		13'866'000	3'269'076		ILS/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		334'750'598	360'842'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		2'431'875	4'579'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		14'243'141	24'862'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		476'402'478	567'989'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		54'330'044	50'801'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		5'268'722	24'712'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		2'082'200	24'991'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		136'816'529	22'881'735'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		79'866'710	676'957'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		3'222'978	13'833'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		1'793'784	21'706'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		2'765'594	22'217'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		20'705'701	32'537'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		4'215'902	6'621'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		39'523	170'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		39'541	479'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		242'000	259'781		GBP/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		89'567	140'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		201'423'000	1'197'806		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		4'597'000	4'265'722		EUR/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		18'618	227'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		94'000	53'688		AUD/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		83'089	157'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		3'836'000	3'259'982		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		3'169'000	376'360		CNY/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		67'445	317'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		70'317	565'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		110'680	18'803'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		340'505	403'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		11'835	100'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		7'543	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		1'045'637	1'126'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		91'000	76'813		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		113'000	13'339		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		3'794'000	22'346		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		8'000	8'611		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		545'000	505'270		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		12'000	7'614		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		137'000	16'236		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		10'000	10'801		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		2'281'000	1'938'861		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		1'062'000	986'609		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		9'000	5'118		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		4'634'000	27'401		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		554'629	653'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		26'450	31'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		5'715	48'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		23'368	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		9'581	1'634'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		2'230'000	13'126		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		45'000	38'214		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		34'000	31'686		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		65'000	7'692		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		183'263'000	1'072'598		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		631'000	692'314		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		55'000	35'425		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		21'000	13'467		CAD/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		18'495	225'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		5'118	24'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		2'678'000	2'519'797		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		16'000	9'062		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		167'000	21'075		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		6'530'000	783'887		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		57'000	30'113		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		4'001'000	3'467'479		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		28'000	26'383		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.02.2024		54'000	12'467		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		26'000	22'564		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		2'112'000	12'395		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		5'000	5'499		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		139'000	11'502		SEK/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		20'126	38'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		350'000	28'831		NOK/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		12'909	20'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		136'000	29'158		PLN/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		29'018	134'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		53'000	6'386		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		19'000	16'488		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		20'000	12'942		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		38'000	20'118		NZD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		12'056	52'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		28'732	348'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		11'343	137'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		10'373	86'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		12'950	20'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		821'410	946'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		132'000	28'594		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		135'000	11'224		SEK/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		20'140	38'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		346'000	28'606		NOK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		6'642	1'129'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.02.2024		51'000	11'769		ILS/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		478'480	506'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		265'000	56'931		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		206'468'000	1'212'473		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		3'430'000	3'235'831		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		5'890'000	715'087		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		20'000	11'433		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.02.2024		171'000	39'663		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		126'000	81'810		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		112'000	59'214		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		359'000	45'430		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		269'000	22'306		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		5'482'000	4'772'048		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		383'000	422'322		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		27'000	17'437		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		490'000	40'453		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		244'000	52'390		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		180'000	22'713		DKK/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		5'821	25'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		704'650	817'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		280'442	47'718'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		5'160	8'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		13'168	14'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		79'000	9'531		CNY/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		32'763	62'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		2'660'162	3'067'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		827'129	140'594'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		41'446	500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		59'000	31'294		NZD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		2'249'228	2'394'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		25'334	23'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		9'636	15'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.02.2024		18'000	4'222		ILS/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		54'787	255'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		23'949	190'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		427'578	3'539'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		4'000	2'588	SGD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		6'281	11'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		314'850	2'622'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.02.2024		18'723	80'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		817'271	872'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		882'451	1'023'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		404'000	33'509	NOK/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		359'917	61'730'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		90'000	11'318	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		145'000	31'115	PLN/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.02.2024		9'266	112'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		56'861	100'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.02.2024		21'239	33'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		41'604	79'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		83'400	130'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		218'381	199'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.02.2024		42'655	355'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.02.2024		175'251	203'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		24'080	22'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.02.2024		5'692	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		9'627	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.02.2024		54'435	255'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.02.2024		41'345	501'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		133'333	143'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		23'782'000	139'136	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		58'000	30'597	NZD/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.02.2024		23'641	189'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		2'570'000	308'457	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		305'000	173'221	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		226'000	48'487	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.02.2024		14'781	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.02.2024		33'247	63'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.02.2024		108'912	18'648'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		476'000	39'237	NOK/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.02.2024		251'597	269'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		348'000	300'307	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.02.2024		39'352	36'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		163'000	20'456	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.02.2024		22'202'000	2'775'494	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.02.2024		6'637'000	4'260'078	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.02.2024		24'539'000	13'913'220	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.02.2024		21'441'000	1'758'398	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.02.2024		353'817'000	329'640'684	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.02.2024		559'003'000	479'409'358	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.02.2024		24'549'000	5'284'933	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.02.2024		665'101'000	79'526'127	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.02.2024		25'176'000	2'090'237	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.02.2024		4'692'000	2'477'001	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.02.2024		49'809'000	54'397'704	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.02.2024		22'544'285'000	132'329'317	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.02.2024		32'660'000	20'965'597	CAD/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		8'727'752	177'160'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		112'266	2'264'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		2'165'000	107'909	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		50'122	996'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		1'009'000	51'007	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		51'450	1'018'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		3'833'000	191'827	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		35'017	698'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		615'000	30'885	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		70'363	1'402'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		619'000	30'963	MXN/CHF		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.02.2024		41'322	824'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.02.2024		176'121'000	8'787'663	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		13'998'000	3'451'186	ILS/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.03.2024		2'713'738	21'744'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.03.2024		4'155'897	6'487'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		3'309'513	14'071'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		13'759'369	24'322'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		318'578'063	342'602'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.03.2024		1'763'251	21'553'000	CHF/NOK		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		468'968'475	548'573'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.03.2024		5'338'060	24'882'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.03.2024		8'606'254	173'830'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		80'084'339	670'813'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.03.2024		2'046'866	24'703'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.03.2024		2'409'296	4'578'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		52'352'038	48'078'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		127'006'607	21'607'186'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		20'067'736	31'348'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		4'802'712	5'592'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		94'796	148'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		117'611	209'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.03.2024		12'401	151'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.03.2024		25'012	116'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		214'434	36'350'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.03.2024		7'884	15'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		3'628'340	30'316'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.03.2024		65'571	1'313'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.03.2024		4'496	7'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.03.2024		13'759	167'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		495'749	455'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		4'063'451	4'364'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.03.2024		31'367	251'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		22'775	97'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.03.2024		13'000	7'321	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.03.2024		17'000	10'911	CAD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		306'394	355'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.03.2024		12'269'000	71'728	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.03.2024		27'000	29'502	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.03.2024		99'000	4'964	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.03.2024		397'000	47'599	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.03.2024		13'000	2'800	PLN/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		391'074	419'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		31'201	5'323'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		16'631	138'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		2'815	5'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		77'449	83'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		112'108	129'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.03.2024		2'161	43'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		3'853	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		11'971	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		691'535	117'601'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		724'880	835'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		9'540	79'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		22'407	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		476'556	507'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		573'346	657'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.03.2024		10'765	210'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		6'559'650	7'415'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.03.2024		6'333	29'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		813'870	730'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		1'798'746	305'280'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		16'584	29'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		1'620'015	13'219'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		4'579'983	4'827'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		342'101	524'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		15'666	24'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.03.2024		3'970	77'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.03.2024		3'361	40'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		839'210	142'479'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.03.2024		6'563	10'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		39'589	323'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.03.2024		2'925	35'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		1'176'874	1'240'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.03.2024		3'773	7'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.03.2024		6'315	11'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		3'392'024	3'834'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.03.2024		5'568	23'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		23'316	21'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.03.2024		2'402	11'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.03.2024		4'585	36'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.03.2024		1'369'000	8'038	JPY/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		794'231	839'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		449'158	3'686'000	CHF/CNY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
	CHF/USD Verfall 05.03.2024		24'000	21'099		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 05.03.2024		10'000	6'513		CAD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		24'624	28'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		8'999	1'534'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 05.03.2024		6'524	10'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		17'060	18'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CHF/SEK Verfall 05.03.2024		212'000	17'976		SEK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/ILS Verfall 05.03.2024		193'000	46'183		ILS/CHF	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 05.03.2024		775'000	860'206		GBP/CHF	0.00	0.00		
	CHF/JPY Verfall 05.03.2024		542'499'000	3'181'550		JPY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 05.03.2024		7'371'000	7'011'074		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/NZD Verfall 05.03.2024		43'000	23'346		NZD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/SGD Verfall 05.03.2024		72'000	47'161		SGD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 05.03.2024		14'465'000	12'727'334		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 05.03.2024		15'689'000	1'919'110		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/NOK Verfall 05.03.2024		287'000	24'084		NOK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 05.03.2024		371'000	213'672		AUD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 05.03.2024		68'000	44'285		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/MXN Verfall 05.03.2024		1'295'000	66'657		MXN/CHF	0.00	0.00		
	CHF/DKK Verfall 05.03.2024		209'000	26'674		DKK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/PLN Verfall 05.03.2024		192'000	42'202		PLN/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		630'974	717'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 05.03.2024		21'000	20'025		EUR/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		888'477	1'011'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		777'999	133'065'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 05.03.2024		43'000	5'243		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CNY/CHF Verfall 05.03.2024		2'280'147	18'700'000		CHF/CNY	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 05.03.2024		8'905	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.03.2024		120'510	137'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 05.03.2024		77'209	81'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 05.03.2024		28'620	4'904'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	CHF/NOK Verfall 05.03.2024		21'452'000	1'782'318		NOK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/DKK Verfall 05.03.2024		21'822'000	2'789'604		DKK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CNY Verfall 05.03.2024		721'145'000	88'123'919		CNY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/AUD Verfall 05.03.2024		24'192'000	13'870'677		AUD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/JPY Verfall 05.03.2024		21'797'585'000	128'241'950		JPY/CHF	0.00	0.00		
	CHF/SEK Verfall 05.03.2024		24'698'000	2'101'936		SEK/CHF	0.00	0.00		
	CHF/CAD Verfall 05.03.2024		31'965'000	20'751'262		CAD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/MXN Verfall 05.03.2024		174'079'000	8'978'856		MXN/CHF	0.00	0.00		
	CHF/NZD Verfall 05.03.2024		4'557'000	2'444'584		NZD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/PLN Verfall 05.03.2024		24'833'000	5'482'928		PLN/CHF	0.00	0.00		
	CHF/GBP Verfall 05.03.2024		48'501'000	54'020'414		GBP/CHF	0.00	0.00		
	CHF/EUR Verfall 05.03.2024		347'612'000	331'235'303		EUR/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 05.03.2024		554'794'000	488'495'007		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/SGD Verfall 05.03.2024		6'432'000	4'212'201		SGD/CHF	0.00	0.00		
	NOK/CHF Verfall 04.04.2024		1'750'817	21'126'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2024		2'747'274	21'528'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2024		13'743'521	24'026'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2024		129'481'175	21'976'207'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2024		2'063'083	24'291'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2024		20'534'811	31'721'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)	
	ILS/CHF Verfall 04.04.2024		3'438'023	13'979'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)	
	MXN/CHF Verfall 04.04.2024		8'934'593	174'631'000		CHF/MXN	0.00	0.00	b)	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2024		2'425'449	4'536'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)	
	PLN/CHF Verfall 04.04.2024		5'455'067	24'797'000		CHF/PLN	0.00	0.00	b)	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2024		51'673'156	46'536'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2024		324'438'123	341'173'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 04.04.2024		474'046'444	540'142'000		CHF/USD	-0.01	0.00	b)	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2024		4'138'507	6'332'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)	
	CNY/CHF Verfall 08.04.2024		88'478'578	725'371'000		CHF/CNY	0.00	0.00	b)	
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>								<b>-0.01</b>	<b>0.00</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	6'095'868.15	0.48
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	663'102'723.22	52.38
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	591'274'267.63	46.71
Derivative Finanzinstrumente	3'198.93	0.00
Sonstige Vermögenswerte	5'387'208.74	0.43
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'265'863'266.67</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-26'681'862.20	

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);	1'254'376'990.85	99.09
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	3'198.93	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Ausgeliehene Effekten		208'027'403.14	16.43
-----------------------	--	----------------	-------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				208'027'403.14	16.43
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	681 USD	91.19%	546'810.00	0.04
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	1'145 USD	77.48%	781'220.57	0.06
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	1'030 USD	82.06%	744'279.38	0.06
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'638 USD	78.67%	1'134'716.70	0.09
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	450 USD	78.78%	312'168.74	0.02
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'446 USD	74.34%	946'600.61	0.07
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'120 USD	74.19%	731'649.00	0.06
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	1'854 USD	77.70%	1'268'534.28	0.10
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	1'850 USD	77.58%	1'263'761.15	0.10
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	2'200 USD	83.05%	1'608'792.46	0.13
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'398 USD	77.48%	1'636'128.32	0.13
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'777 USD	50.78%	1'241'747.48	0.10
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	3'357 USD	52.48%	1'551'441.61	0.12
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	2'774 USD	61.08%	1'491'922.07	0.12
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	2'461 USD	61.69%	1'336'788.83	0.11
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	3'500 USD	59.88%	1'845'302.59	0.15
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	3'400 USD	68.89%	2'062'495.60	0.16
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'500 USD	73.00%	1'607'003.75	0.13
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'500 USD	61.61%	1'898'754.88	0.15
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	3'464 USD	59.61%	1'818'220.33	0.14
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	3'200 USD	65.44%	1'843'871.70	0.15
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	2'521 USD	73.50%	1'631'601.91	0.13
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	2'900 USD	75.34%	1'923'974.23	0.15
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	2'155 USD	84.09%	1'595'750.59	0.13
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	490 USD	93.66%	404'098.16	0.03
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	1'909 USD	93.36%	1'569'343.12	0.12
US912810TV08	4.7500 % T 4 3/4 11/15/53	1'000 USD	106.45%	937'372.95	0.07
US912810TW80	4.7500 % T 4 3/4 11/15/43	650 USD	102.92%	589'081.10	0.05
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	2'500 USD	93.03%	2'047'966.68	0.16
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	1'110 USD	97.69%	954'807.88	0.08
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	400 USD	94.27%	332'022.37	0.03
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	3'590 USD	94.47%	2'986'322.04	0.24
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'000 USD	94.22%	2'488'929.61	0.20
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	2'600 USD	95.06%	2'176'389.39	0.17
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	3'300 USD	92.64%	2'691'965.03	0.21
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'000 USD	91.22%	1'606'453.41	0.13
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	408 USD	97.09%	348'823.28	0.03
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	3'000 USD	96.05%	2'537'222.41	0.20
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	700 USD	95.95%	591'440.64	0.05
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	2'940 USD	94.39%	2'443'600.42	0.19
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	2'750 USD	93.75%	2'270'167.97	0.18
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'130 USD	94.00%	1'763'037.21	0.14
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	3'000 USD	93.98%	2'482'738.37	0.20
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	1'657 USD	87.69%	1'279'423.19	0.10
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	4'309 USD	92.05%	3'492'525.52	0.28
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	2'200 USD	96.20%	1'863'656.46	0.15
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	2'080 USD	94.86%	1'737'391.28	0.14
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'850 USD	88.58%	1'442'953.08	0.11
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	4'421 USD	80.28%	3'125'278.05	0.25
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	2'100 USD	94.38%	1'745'140.03	0.14

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
US91282ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	2'209 USD	94.09%	1'830'250.42	0.14	
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	2'000 USD	93.77%	1'651'306.33	0.13	
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	2'406 USD	87.39%	1'851'460.56	0.15	
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	3'100 USD	79.61%	2'173'101.23	0.17	
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'220 USD	93.45%	1'826'841.21	0.14	
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	2'900 USD	92.86%	2'371'252.48	0.19	
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	5'717 USD	80.50%	4'052'454.00	0.32	
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'800 USD	92.77%	2'287'173.47	0.18	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	3'348 USD	92.20%	2'718'223.03	0.21	
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	2'900 USD	87.20%	2'226'814.51	0.18	
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	4'000 USD	81.53%	2'871'693.69	0.23	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'152 USD	88.33%	2'451'541.32	0.19	
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'400 USD	92.19%	2'759'973.91	0.22	
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	2'062 USD	92.45%	1'678'665.84	0.13	
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	4'790 USD	83.81%	3'535'072.54	0.28	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	1'800 USD	88.19%	1'397'763.06	0.11	
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	3'200 USD	88.02%	2'480'068.93	0.20	
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'350 USD	92.00%	1'903'749.10	0.15	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'100 USD	91.16%	1'685'620.35	0.13	
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	3'339 USD	86.84%	2'553'342.11	0.20	
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	3'200 USD	80.97%	2'281'505.05	0.18	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	3'103 USD	87.13%	2'380'557.02	0.19	
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	2'915 USD	91.20%	2'341'004.65	0.18	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	3'100 USD	87.80%	2'396'595.82	0.19	
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	1'928 USD	91.66%	1'556'048.52	0.12	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	5'880 USD	81.19%	4'203'591.60	0.33	
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	2'941 USD	91.77%	2'376'452.01	0.19	
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	2'170 USD	87.42%	1'670'451.60	0.13	
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	5'851 USD	83.98%	4'326'957.60	0.34	
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'200 USD	92.91%	1'799'789.17	0.14	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'350 USD	91.38%	1'890'816.02	0.15	
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	2'126 USD	94.56%	1'770'256.62	0.14	
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	2'000 USD	97.42%	1'715'696.73	0.14	
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	5'000 USD	90.41%	3'980'361.17	0.31	
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	2'514 USD	94.66%	2'095'407.97	0.17	
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	1'945 USD	95.13%	1'629'177.10	0.13	
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	558 USD	97.55%	479'293.57	0.04	
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	5'288 USD	89.28%	4'157'246.06	0.33	
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	2'115 USD	95.97%	1'787'286.73	0.14	
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	1'750 USD	98.02%	1'510'383.95	0.12	
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	2'104 USD	99.19%	1'837'624.20	0.15	
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	1'847 USD	99.19%	1'613'161.55	0.13	
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	5'388 USD	98.94%	4'693'994.11	0.37	
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	1'772 USD	97.94%	1'528'152.70	0.12	
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	2'087 USD	98.33%	1'806'983.58	0.14	
US91282CGM73	3.5000 % T 3 1/2 02/15/33	5'380 USD	94.34%	4'469'402.13	0.35	
US91282CGN56	4.6250 % T 4 5/8 02/28/25	2'200 USD	99.58%	1'929'037.30	0.15	
US91282CGS44	3.6250 % T 3 5/8 03/31/30	1'793 USD	96.52%	1'523'813.85	0.12	
US91282CGU99	3.8750 % T 3 7/8 03/31/25	1'400 USD	98.80%	1'217'938.30	0.10	
US91282CHC82	3.3750 % T 3 3/8 05/15/33	4'000 USD	93.31%	3'286'652.88	0.26	
US91282CHQ78	4.1250 % T 4 1/8 07/31/28	2'390 USD	99.30%	2'089'717.24	0.17	
US91282CHT18	3.8750 % T 3 7/8 08/15/33	4'000 USD	97.02%	3'417'084.17	0.27	
US91282CJE21	5.0000 % T 5 10/31/25	2'100 USD	100.39%	1'856'378.17	0.15	
US91282CJJ18	4.5000 % T 4 1/2 11/15/33	5'000 USD	101.91%	4'486'677.42	0.35	
US91282CJ80	4.6250 % T 4 5/8 11/15/26	1'000 USD	100.38%	883'852.06	0.07	

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57337013
CAD	1 = CHF	0.64920559
CNY	1 = CHF	0.12220950
DKK	100 = CHF	12.78327000
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
ILS	1 = CHF	0.24654217
JPY	100 = CHF	0.58832800
MXN	1 = CHF	0.05159523
NOK	100 = CHF	8.30766300
NZD	1 = CHF	0.53647509
PLN	1 = CHF	0.22080544
SEK	100 = CHF	8.50982600
SGD	1 = CHF	0.65487877
USD	1 = CHF	0.88055000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	25'017'714.88	11.212
Bond	CHF	198'111'801.55	88.788
Total	CHF	223'129'516.43	100.000

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

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'144'770'449.40	92.384

## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	0.001
FA CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	0.001
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	0.001
GT CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	0.001
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	0.001
NT CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	0.001
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.063	0.00 - 0.01	-	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.

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	208'027'403.14
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FAH1 CHF	0.200	0.550	0.150	0.050	3.000
GTH1 CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

**Periode:** 01.03.2023 - 10.08.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DTH1 CHF	0.200	0.450	0.150	0.050	3.000

**Periode:** 25.07.2023 - 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	0.130	0.050	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	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.

## 9 Benchmark

FTSE Non-CHF World Government Bond Index

## 10 TER

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

## 11 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

**Ex-Datum:** 18.06.2024 **Ausschüttung an Anteilscheininhaber**  
**Zahlbar:** 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	1.55000	0.54250	1.00750
FAH1 CHF	Nein	CHF	1.55000	0.54250	1.00750

## 12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

**Ex-Datum:** 18.06.2024 **Thesaurierung an Anteilscheininhaber**  
**Zahlbar:** 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT CHF	Nein	CHF	1.646	0.576	1.070
GTH1 CHF	Nein	CHF	1.762	0.616	1.146
NT CHF	Nein	CHF	1.862	0.651	1.211
NTH1 CHF	Nein	CHF	2.195	0.768	1.427

## 13 Fussnoten

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

## 14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

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

mit den Teilvermögen

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

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

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

### I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

#### 1 Geplante Vereinigung

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

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

#### 2 Begründung für die Vereinigung

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

#### 3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

#### 4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

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

## 5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

## 6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie der Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf [www.fundinfo.com](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 Referenzindex zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimized Sampling).

Das Teilvermögen

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

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

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

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

## 2.2 Flüssige Mittel

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

## 2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### **5 Rücknahmebedingungen**

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

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

## 6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<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 Anteilsklassen 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 Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. November 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

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

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

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

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

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

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

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

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

## 2 Gating-Verfahren

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<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