

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

## Jahresbericht per 28.02.2023

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
FAH1 CHF	31562131	CHF
GTH1 CHF	33096815	CHF
NTH1 CHF	11704531	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

Zürich, 28. Juni 2023

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

### Swisscanto (CH) Index Fund V, Zürich

### 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 USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ 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<sup>1</sup>
- ▶ 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

<sup>1</sup> Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate 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 28. Februar 2023, 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 beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

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

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



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

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



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

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

<sup>1</sup> Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate 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 28. Februar 2023, 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	3
2	Vertriebsorganisation	4
3	Abschlusszahlen	5
4	Collateral ausgeliehene Effekten	31
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	31
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	31
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	31
8	Pauschale Verwaltungskommission	32
9	Benchmark	32
10	TER	32
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	33
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	33
13	Fussnoten	33
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte Pflichtpublikationen	34 36

# 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 (ab 03.01.2023)  
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 bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022	01.03.2020 28.02.2021	01.03.2019 29.02.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'011'107'250.39	981'248'192.20	1'199'186'259.19	1'399'194'194.62
<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	9'004'166.73
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		116'032.595	114'262.676	53'641.746	77'043.800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		94.3913	109.0696	113.4301	116.8708
Thesaurierung je Anteil		1.69	1.75	1.93	2.05
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.20 %	0.20 %	0.22 %	0.22 %
<b>Klasse FAH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'010'392.02	7'284'756.10	13'847'751.62	54'761'093.09
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		81'115.045	84'089.939	151'909.167	576'585.822
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		74.0971	86.6305	91.1581	94.9747
Ausschüttung je Anteil		1.40	1.40	1.60	1.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.20 %	0.21 %	0.24 %	0.26 %
<b>Klasse GTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		172'906'830.22	26'622'815.71	24'046'188.68	142'680'523.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'082'497.748	277'561.239	241'123.137	1'388'652.136
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.0286	95.9169	99.7258	102.7475
Thesaurierung je Anteil		1.52	1.58	1.74	1.84
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.16 %	0.16 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse NTH1 CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		821'237'561.75	934'878'034.66	1'155'207'728.56	1'192'748'411.29
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'536'598.663	8'420'077.739	10'017'146.214	10'051'151.186
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		96.2020	111.0296	115.3230	118.6678
Thesaurierung je Anteil		1.92	2.01	2.22	2.33
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

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DTH1 CHF	-12.92 %	-15.31 %	-3.56 %	4.21 %
Klasse FAH1 CHF	-12.93 %	-15.32 %	-3.56 %	4.17 %
Klasse GTH1 CHF	-12.89 %	-15.28 %	-3.52 %	4.23 %
Klasse NTH1 CHF	-12.75 %	-15.14 %	-3.36 %	4.42 %
Benchmark Hedge	-12.83 %	-15.21 %	-	-
Benchmark	-	-	-3.37 %	4.47 %
Tracking Error 33)	0.10 %	0.12 %	0.05 %	0.07 %

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	-0.09 %
Klasse FAH1 CHF	-0.10 %
Klasse GTH1 CHF	-0.06 %
Klasse NTH1 CHF	0.08 %

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 abweichenden Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	28.02.2023	28.02.2022
Bankguthaben auf Sicht	5'986'447.54	4'778'130.18
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	574'051'207.69	543'101'303.62
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	433'778'508.31	418'751'133.65
Derivative Finanzinstrumente	-5'821'910.06	11'749'349.58
Sonstige Vermögenswerte	3'136'706.40	2'874'562.58
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'011'130'959.88</b>	<b>981'254'479.61</b>
Andere Verbindlichkeiten	-23'709.49	-6'287.41
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'011'107'250.39</b>	<b>981'248'192.20</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DTH1 CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		114'262.676	53'641.746
Ausgegebene Anteile		2'310.205	63'112.634
Zurückgenommene Anteile		-540.286	-2'491.704
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>116'032.595</b>	<b>114'262.676</b>

Klasse FAH1 CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		84'089.939	151'909.167
Ausgegebene Anteile		8'978.006	18'682.398
Zurückgenommene Anteile		-11'952.900	-86'501.626
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>81'115.045</b>	<b>84'089.939</b>

Klasse GTH1 CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		277'561.239	241'123.137
Ausgegebene Anteile		1'978'385.434	67'213.772
Zurückgenommene Anteile		-173'448.925	-30'775.670
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'082'497.748</b>	<b>277'561.239</b>

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'420'077.739	10'017'146.214
Ausgegebene Anteile		1'950'629.764	1'619'021.211
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		29'757.587	-
Zurückgenommene Anteile		-1'863'866.427	-3'216'089.686
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>8'536'598.663</b>	<b>8'420'077.739</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NTH1 CHF	19.07.2022	1'758'711.50	17'189.555
Klasse NTH1 CHF	25.07.2022	1'301'180.92	12'568.032

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		981'248'192.20	1'199'186'259.19
Ausbezahlte Ausschüttung		-118'388.70	-250'543.20
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-5'960'026.08	-8'381'920.16
Saldo aus dem Anteilverkehr		159'279'931.44	-175'856'225.64
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-123'342'458.47	-33'449'377.99
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'011'107'250.39</b>	<b>981'248'192.20</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		7'644.85	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-8'987.11	-26'164.02
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		8'937'233.81	9'676'851.70
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		7'812'853.87	11'738'558.68
Erträge aus Wertpapierleihe		63'802.90	79'839.55
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		5'370'101.41	1'706'147.22
<b>Total Ertrag</b>		<b>22'182'649.73</b>	<b>23'175'233.13</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-1'249.65	-186.10
Reglementarische Vergütungen		-87'153.37	-83'424.73
Sonstige Aufwendungen		-499.85	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-2'136'543.23	-5'348'226.45
<b>Total Aufwand</b>		<b>-2'225'446.10</b>	<b>-5'431'837.28</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>19'957'203.63</b>	<b>17'743'395.85</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'005'839.92	-23'559'384.40
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		436'147.06	234'725.81
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>17'387'510.77</b>	<b>-5'581'262.74</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-140'729'969.24	-27'868'115.25
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-123'342'458.47</b>	<b>-33'449'377.99</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse DTH1 CHF</b>	<b>28.02.2023</b>	<b>28.02.2022</b>
Nettoertrag	196'764.45	200'341.29
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>196'764.45</b>	<b>200'341.29</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	68'867.56	70'119.45
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	127'896.89	130'221.84
<b>Total</b>	<b>196'764.45</b>	<b>200'341.29</b>
<b>Klasse FAH1 CHF</b>	<b>28.02.2023</b>	<b>28.02.2022</b>
Nettoertrag	108'526.90	111'184.25
Vortrag des Vorjahres	8'346.52	14'888.18
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>116'873.42</b>	<b>126'072.43</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	113'561.06	117'725.91
Vortrag auf neue Rechnung	3'312.36	8'346.52
<b>Total</b>	<b>116'873.42</b>	<b>126'072.43</b>
<b>Klasse GTH1 CHF</b>	<b>28.02.2023</b>	<b>28.02.2022</b>
Nettoertrag	3'178'766.97	438'967.76
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>3'178'766.97</b>	<b>438'967.76</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'112'568.44	153'638.72
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'066'198.53	285'329.04
<b>Total</b>	<b>3'178'766.97</b>	<b>438'967.76</b>
<b>Klasse NTH1 CHF</b>	<b>28.02.2023</b>	<b>28.02.2022</b>
Nettoertrag	16'473'145.31	16'992'902.55
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>16'473'145.31</b>	<b>16'992'902.55</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	5'765'600.86	5'947'515.89
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	10'707'544.45	11'045'386.66
<b>Total</b>	<b>16'473'145.31</b>	<b>16'992'902.55</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>574'051'207.69</b>	<b>56.77</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>574'051'207.69</b>	<b>56.77</b>	
JP1024221M37	0.1000 % JGB 0.1 03/01/23 422	83'000	0	83'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024251M63	0.0050 % JGB 0.005 06/01/23 425	70'000	0	70'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024261M79	0.0050 % JGB 0.005 07/01/23 426	150'000	0	150'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024281M91	0.0050 % JGB 0.005 09/01/23 428	0	50'000	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024291MA8	0.0050 % JGB 0.005 10/01/23 429	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024301MB3	0.0050 % JGB 0.005 11/01/23 430	60'000	0	60'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024321N19	0.0050 % JGB 0.005 01/01/24 432	0	50'000	0	50'000 JPY	100.07%	344'274.32	0.03	a)
JP1024331N25	0.0050 % JGB 0.005 02/01/24 433	0	80'000	0	80'000 JPY	100.09%	550'965.52	0.05	a)
JP1024341N31	0.0050 % JGB 0.005 03/01/24 434	0	100'000	0	100'000 JPY	100.07%	688'521.12	0.07	a)
JP1024351N46	0.0050 % JGB 0.005 04/01/24 435	0	70'000	0	70'000 JPY	100.06%	481'926.26	0.05	a)
JP1024361N51	0.0050 % JGB 0.005 05/01/24 436	0	90'000	0	90'000 JPY	100.06%	619'631.86	0.06	a)
JP1024371N67	0.0050 % JGB 0.005 06/01/24 437	0	80'000	0	80'000 JPY	100.06%	550'794.88	0.05	a)
JP1024381N73	0.0050 % JGB 0.005 07/01/24 438	0	30'000	0	30'000 JPY	100.08%	206'579.04	0.02	a)
JP1024391N89	0.0050 % JGB 0.005 08/01/24 439	0	20'000	0	20'000 JPY	100.08%	137'722.11	0.01	a)
JP1024401N95	0.0050 % JGB 0.005 09/01/24 440	0	20'000	0	20'000 JPY	100.08%	137'724.87	0.01	a)
JP1024411NA0	0.0050 % JGB 0.005 10/01/24 441	0	54'000	0	54'000 JPY	100.08%	371'860.86	0.04	a)
JP1024421NB7	0.0050 % JGB 0.005 11/01/24 442	0	144'000	0	144'000 JPY	100.08%	991'638.86	0.10	a)
JP1024431NC4	0.0050 % JGB 0.005 12/01/24 443	0	123'000	0	123'000 JPY	100.08%	847'033.32	0.08	a)
JP1024441P12	0.0050 % JGB 0.005 01/01/25 444	0	142'000	0	142'000 JPY	100.10%	978'051.74	0.10	a)
JP1051351J37	0.1000 % JGB 0.1 03/20/23 135	110'000	0	110'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051361J76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/23 136	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051371JA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/23 137	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051381K12	0.1000 % JGB 0.1 12/20/23 138	95'000	0	95'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	100'000	0	0	100'000 JPY	100.16%	689'147.27	0.07	a)
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	100'000	0	0	100'000 JPY	100.20%	689'443.13	0.07	a)
JP1051411KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/24 141	80'000	0	0	80'000 JPY	100.23%	551'719.64	0.05	a)
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	78'000	0	0	78'000 JPY	100.26%	538'066.19	0.05	a)
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	86'000	40'000	30'000	96'000 JPY	100.30%	662'499.53	0.07	a)
JP1051441L76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/25 144	140'000	0	0	140'000 JPY	100.30%	966'212.58	0.10	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	70'000	0	0	70'000 JPY	100.30%	483'106.29	0.05	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	91'000	0	0	91'000 JPY	100.30%	627'994.35	0.06	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	140'000	0	70'000	70'000 JPY	99.98%	481'560.20	0.05	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	100'000	0	40'000	60'000 JPY	99.92%	412'522.31	0.04	a)
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	85'000	0	0	85'000 JPY	99.82%	583'798.36	0.06	a)
JP1051501N14	0.0050 % JGB 0.005 12/20/26 150	70'000	40'000	0	110'000 JPY	99.71%	754'640.92	0.07	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	0	100'000	0	100'000 JPY	99.54%	684'881.25	0.07	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	0	110'000	0	110'000 JPY	99.92%	756'268.20	0.07	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	0	174'000	0	174'000 JPY	99.41%	1'190'136.97	0.12	a)
JP1051541NA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 154	0	196'000	0	196'000 JPY	99.65%	1'343'891.18	0.13	a)
JP1103281D37	0.6000 % JGB 0.6 03/20/23 328	230'000	0	230'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103291D68	0.8000 % JGB 0.8 06/20/23 329	240'000	0	240'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103301D90	0.8000 % JGB 0.8 09/20/23 330	110'000	0	110'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103311DB5	0.6000 % JGB 0.6 09/20/23 331	35'000	0	35'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	213'000	0	130'000	83'000 JPY	100.54%	574'202.37	0.06	a)
JP1103331E36	0.6000 % JGB 0.6 03/20/24 333	70'000	0	0	70'000 JPY	100.67%	484'888.38	0.05	a)
JP1103341E67	0.6000 % JGB 0.6 06/20/24 334	85'000	0	0	85'000 JPY	100.85%	589'845.78	0.06	a)
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	100'000	0	0	100'000 JPY	100.85%	693'936.21	0.07	a)
JP1103361EC6	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/24 336	28'000	0	0	28'000 JPY	100.98%	194'542.96	0.02	a)
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	30'000	0	0	30'000 JPY	100.62%	207'693.71	0.02	a)
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	43'000	0	0	43'000 JPY	100.91%	298'567.13	0.03	a)
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	95'000	0	0	95'000 JPY	100.99%	660'161.07	0.07	a)
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	50'000	0	10'000	40'000 JPY	101.07%	278'171.73	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	20'000	25'000	0	45'000 JPY	100.86%	312'283.68	0.03	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	65'000	0	30'000	35'000 JPY	100.27%	241'478.49	0.02	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	60'000	0	0	60'000 JPY	100.24%	413'818.63	0.04	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	70'000	0	0	70'000 JPY	100.16%	482'398.27	0.05	a)
JP1103451GC0	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	147'000	0	20'000	127'000 JPY	100.07%	874'413.09	0.09	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	50'000	30'000	0	80'000 JPY	99.92%	550'013.24	0.05	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	76'000	10'000	0	86'000 JPY	99.81%	590'636.99	0.06	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	53'000	30'000	0	83'000 JPY	99.65%	569'096.78	0.06	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	45'000	24'000	0	69'000 JPY	99.52%	472'477.86	0.05	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	64'000	30'000	30'000	64'000 JPY	99.37%	437'566.58	0.04	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	53'000	14'000	0	67'000 JPY	99.17%	457'169.33	0.05	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	45'000	13'000	0	58'000 JPY	98.96%	394'916.47	0.04	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	65'000	59'000	50'000	74'000 JPY	98.79%	502'983.17	0.05	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	50'000	32'000	20'000	62'000 JPY	98.56%	420'462.74	0.04	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	50'000	30'000	15'000	65'000 JPY	98.32%	439'707.50	0.04	a)
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	93'000	31'000	60'000	64'000 JPY	98.12%	432'075.25	0.04	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	130'000	71'000	50'000	151'000 JPY	97.91%	1'017'276.85	0.10	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	142'000	0	142'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	145'000	0	25'000	120'000 JPY	97.49%	804'914.54	0.08	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	105'000	0	40'000	65'000 JPY	97.14%	434'430.02	0.04	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	178'000	14'000	100'000	92'000 JPY	96.84%	613'018.16	0.06	a)
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	118'000	0	20'000	98'000 JPY	96.59%	651'284.86	0.06	a)
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	280'000	24'000	160'000	144'000 JPY	96.35%	954'671.49	0.09	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	140'000	55'000	120'000	75'000 JPY	96.19%	496'388.74	0.05	a)
JP1103651N11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/31 365	50'000	10'000	0	60'000 JPY	96.11%	396'764.20	0.04	a)
JP1103661N43	0.2000 % JGB 0.2 03/20/32 366	0	30'000	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	0	67'000	67'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103681NA2	0.2000 % JGB 0.2 09/20/32 368	0	55'000	55'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200611349	1.0000 % JGB 1 03/20/23 61	35'000	0	35'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200621363	0.8000 % JGB 0.8 06/20/23 62	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200631388	1.8000 % JGB 1.8 06/20/23 63	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP12006413A0	1.9000 % JGB 1.9 09/20/23 64	45'000	0	45'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP12006513C3	1.9000 % JGB 1.9 12/20/23 65	35'000	0	35'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200671434	1.9000 % JGB 1.9 03/20/24 67	15'000	0	0	15'000 JPY	102.05%	105'327.92	0.01	a)
JP1200691457	2.1000 % JGB 2.1 03/20/24 69	45'000	0	0	45'000 JPY	102.26%	316'633.98	0.03	a)
JP1200701462	2.4000 % JGB 2.4 06/20/24 70	50'000	0	0	50'000 JPY	103.20%	355'049.45	0.04	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	0	40'000	0	40'000 JPY	103.34%	284'430.38	0.03	a)
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	42'000	0	0	42'000 JPY	103.69%	299'648.91	0.03	a)
JP1200751533	2.1000 % JGB 2.1 03/20/25 75	30'000	0	0	30'000 JPY	104.40%	215'510.84	0.02	a)
JP1200761540	1.9000 % JGB 1.9 03/20/25 76	30'000	0	0	30'000 JPY	103.99%	214'662.45	0.02	a)
JP1200811592	2.0000 % JGB 2 09/20/25 81	30'000	0	0	30'000 JPY	105.16%	217'075.51	0.02	a)
JP12008215A7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/25 82	20'000	0	0	20'000 JPY	105.42%	145'067.92	0.01	a)
JP12008315C1	2.1000 % JGB 2.1 12/20/25 83	30'000	0	0	30'000 JPY	105.91%	218'615.40	0.02	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	70'000	0	30'000	40'000 JPY	105.63%	290'713.81	0.03	a)
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	50'000	0	0	50'000 JPY	106.37%	365'962.20	0.04	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	25'000	0	0	25'000 JPY	106.99%	184'032.12	0.02	a)
JP1200871653	2.2000 % JGB 2.2 03/20/26 87	50'000	0	10'000	40'000 JPY	106.68%	293'609.20	0.03	a)
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	78'000	0	0	78'000 JPY	107.50%	576'938.81	0.06	a)
JP1200891685	2.2000 % JGB 2.2 06/20/26 89	25'000	0	0	25'000 JPY	107.17%	184'348.63	0.02	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	72'000	0	0	72'000 JPY	107.61%	533'103.85	0.05	a)
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	96'000	0	0	96'000 JPY	107.65%	711'089.17	0.07	a)
JP1200931739	2.0000 % JGB 2 03/20/27 93	50'000	0	0	50'000 JPY	107.63%	370'266.05	0.04	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	54'000	0	0	54'000 JPY	108.03%	401'384.71	0.04	a)
JP1200951760	2.3000 % JGB 2.3 06/20/27 95	50'000	0	0	50'000 JPY	109.23%	375'770.59	0.04	a)
JP1200961785	2.1000 % JGB 2.1 06/20/27 96	25'000	0	0	25'000 JPY	108.37%	186'412.83	0.02	a)
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	45'000	0	0	45'000 JPY	109.14%	337'936.54	0.03	a)
JP12009817B7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/27 98	30'000	0	0	30'000 JPY	108.69%	224'358.01	0.02	a)
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	92'000	0	0	92'000 JPY	109.09%	690'556.98	0.07	a)
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	75'000	30'000	35'000	70'000 JPY	109.91%	529'373.29	0.05	a)
JP1201011853	2.4000 % JGB 2.4 03/20/28 101	30'000	0	0	30'000 JPY	110.91%	228'936.40	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	42'000	15'000	0	57'000 JPY	111.26%	436'359.71	0.04	a)
JP1201031877	2.3000 % JGB 2.3 06/20/28 103	35'000	0	0	35'000 JPY	110.74%	266'680.66	0.03	a)
JP1201041884	2.1000 % JGB 2.1 06/20/28 104	30'000	0	0	30'000 JPY	109.69%	226'422.21	0.02	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	62'000	10'000	22'000	50'000 JPY	110.01%	378'481.57	0.04	a)
JP12010618A8	2.2000 % JGB 2.2 09/20/28 106	0	30'000	0	30'000 JPY	110.56%	228'218.06	0.02	a)
JP12010718C2	2.1000 % JGB 2.1 12/20/28 107	30'000	0	0	30'000 JPY	110.25%	227'582.29	0.02	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	40'000	10'000	0	50'000 JPY	109.11%	375'378.39	0.04	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	40'000	0	0	40'000 JPY	109.30%	300'817.39	0.03	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	60'000	0	0	60'000 JPY	110.49%	456'126.49	0.05	a)
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	50'000	0	0	50'000 JPY	111.39%	383'205.15	0.04	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	50'000	0	0	50'000 JPY	110.77%	381'082.47	0.04	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	60'000	0	0	60'000 JPY	111.04%	458'426.01	0.05	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	64'000	0	0	64'000 JPY	111.30%	490'101.87	0.05	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	30'000	0	0	30'000 JPY	111.96%	231'103.82	0.02	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	50'000	0	0	50'000 JPY	112.36%	386'556.04	0.04	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	92'000	0	0	92'000 JPY	111.67%	706'920.59	0.07	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	40'000	0	0	40'000 JPY	111.15%	305'917.34	0.03	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	39'000	0	0	39'000 JPY	109.73%	294'466.94	0.03	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	50'000	0	0	50'000 JPY	108.24%	372'385.30	0.04	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	50'000	14'000	0	64'000 JPY	110.49%	486'548.14	0.05	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	50'000	21'000	20'000	51'000 JPY	109.76%	385'156.37	0.04	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	90'000	0	0	90'000 JPY	112.18%	694'667.63	0.07	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	50'000	0	0	50'000 JPY	111.43%	383'339.33	0.04	a)
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	70'000	26'000	30'000	66'000 JPY	113.14%	513'782.52	0.05	a)
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	60'000	0	20'000	40'000 JPY	111.59%	307'122.83	0.03	a)
JP1201271B58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/31 127	75'000	0	40'000	35'000 JPY	110.82%	266'868.51	0.03	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	100'000	0	20'000	80'000 JPY	110.99%	610'937.44	0.06	a)
JP1201291B88	1.8000 % JGB 1.8 06/20/31 129	65'000	0	25'000	40'000 JPY	110.19%	303'277.92	0.03	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	100'000	14'000	30'000	84'000 JPY	110.42%	638'218.75	0.06	a)
JP1201311BB0	1.7000 % JGB 1.7 09/20/31 131	45'000	0	0	45'000 JPY	109.60%	339'367.03	0.03	a)
JP1201321BC7	1.7000 % JGB 1.7 12/20/31 132	75'000	14'000	20'000	69'000 JPY	109.71%	520'875.53	0.05	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	80'000	0	10'000	70'000 JPY	110.55%	532'475.10	0.05	a)
JP1201341C38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/32 134	80'000	0	25'000	55'000 JPY	110.78%	419'217.20	0.04	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	30'000	0	0	30'000 JPY	109.91%	226'884.59	0.02	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	40'000	0	0	40'000 JPY	109.05%	300'137.58	0.03	a)
JP1201371C64	1.7000 % JGB 1.7 06/20/32 137	38'000	0	0	38'000 JPY	110.06%	287'761.04	0.03	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	40'000	0	0	40'000 JPY	108.19%	297'776.13	0.03	a)
JP1201391C86	1.6000 % JGB 1.6 06/20/32 139	40'000	0	0	40'000 JPY	109.17%	300'473.35	0.03	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	125'000	0	0	125'000 JPY	110.19%	947'760.69	0.09	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	100'000	0	30'000	70'000 JPY	110.22%	530'851.95	0.05	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	52'000	0	0	52'000 JPY	111.14%	397'660.34	0.04	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	76'000	0	0	76'000 JPY	109.20%	571'035.34	0.06	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	60'000	20'000	30'000	50'000 JPY	108.25%	372'426.58	0.04	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	103'000	60'000	60'000	103'000 JPY	110.10%	780'309.88	0.08	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	94'000	13'000	10'000	97'000 JPY	110.16%	735'202.00	0.07	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	95'000	14'000	20'000	89'000 JPY	109.08%	667'953.08	0.07	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	90'000	17'000	10'000	97'000 JPY	108.06%	721'186.07	0.07	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	98'000	40'000	50'000	88'000 JPY	107.92%	653'478.70	0.06	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	100'000	37'000	15'000	122'000 JPY	106.84%	896'817.58	0.09	a)
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	105'000	40'000	50'000	95'000 JPY	104.50%	683'065.44	0.07	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	100'000	19'000	10'000	109'000 JPY	104.40%	782'955.22	0.08	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	80'000	0	0	80'000 JPY	105.40%	580'172.59	0.06	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	74'000	10'000	0	84'000 JPY	104.17%	602'048.99	0.06	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	86'000	41'000	20'000	107'000 JPY	101.61%	748'077.66	0.07	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	55'000	10'000	0	65'000 JPY	94.08%	420'766.73	0.04	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	80'000	0	0	80'000 JPY	91.32%	502'646.70	0.05	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	90'000	20'000	10'000	100'000 JPY	94.81%	652'349.44	0.06	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	90'000	67'000	50'000	107'000 JPY	95.87%	705'825.32	0.07	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	80'000	19'000	0	99'000 JPY	96.97%	660'512.32	0.07	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	70'000	0	0	70'000 JPY	95.34%	459'187.71	0.05	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	60'000	10'000	0	70'000 JPY	104.63%	503'966.42	0.05	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	37'000	14'000	10'000	41'000 JPY	106.53%	300'534.73	0.03	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	30'000	0	0	30'000 JPY	102.53%	211'638.40	0.02	a)
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	35'000	13'000	0	48'000 JPY	102.47%	338'439.79	0.03	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	70'000	10'000	15'000	65'000 JPY	90.34%	404'021.93	0.04	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	60'000	16'000	10'000	66'000 JPY	80.05%	363'544.60	0.04	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	55'000	82'000	62'000	75'000 JPY	83.79%	432'393.34	0.04	a)
JP1300531GCO	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	65'000	43'000	40'000	68'000 JPY	85.60%	400'528.75	0.04	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	47'000	10'000	0	57'000 JPY	89.42%	350'707.54	0.03	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	60'000	5'000	0	65'000 JPY	89.19%	398'887.58	0.04	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	58'000	25'000	10'000	73'000 JPY	88.96%	446'811.10	0.04	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	66'000	29'000	10'000	85'000 JPY	88.72%	518'890.93	0.05	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	76'000	33'000	12'000	97'000 JPY	88.49%	590'571.00	0.06	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	85'000	23'000	0	108'000 JPY	86.15%	640'206.16	0.06	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	64'000	10'000	10'000	64'000 JPY	90.22%	397'273.37	0.04	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	60'000	33'000	0	93'000 JPY	85.58%	547'602.80	0.05	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	85'000	0	0	85'000 JPY	81.03%	473'932.98	0.05	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	89'000	16'000	10'000	95'000 JPY	78.52%	513'237.09	0.05	a)
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	95'000	0	20'000	75'000 JPY	78.24%	403'737.07	0.04	a)
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	86'000	19'000	0	105'000 JPY	78.10%	564'271.02	0.06	a)
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	95'000	0	0	95'000 JPY	77.75%	508'223.49	0.05	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	119'000	16'000	10'000	125'000 JPY	81.99%	705'156.86	0.07	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	130'000	71'000	65'000	136'000 JPY	81.80%	765'498.21	0.08	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	120'000	23'000	10'000	133'000 JPY	84.06%	769'230.08	0.08	a)
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	136'000	56'000	60'000	132'000 JPY	83.89%	761'911.45	0.08	a)
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	130'000	0	10'000	120'000 JPY	83.63%	690'549.55	0.07	a)
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	55'000	100'000	27'000	128'000 JPY	83.80%	738'012.96	0.07	a)
JP1300731N17	0.7000 % JGB 0.7 12/20/51 73	50'000	89'000	0	139'000 JPY	83.71%	800'603.87	0.08	a)
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	0	143'000	0	143'000 JPY	90.78%	893'236.61	0.09	a)
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	0	160'000	16'000	144'000 JPY	98.02%	971'188.41	0.10	a)
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	0	115'000	0	115'000 JPY	100.43%	794'687.45	0.08	a)
JP1300771P16	1.6000 % JGB 1.6 12/20/52 77	0	56'000	0	56'000 JPY	104.90%	404'182.67	0.04	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	32'000	0	0	32'000 JPY	122.68%	270'109.78	0.03	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	60'000	24'000	20'000	64'000 JPY	118.43%	521'512.95	0.05	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	60'000	18'000	15'000	63'000 JPY	118.55%	513'897.49	0.05	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	88'000	0	15'000	73'000 JPY	118.89%	597'166.26	0.06	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	94'000	0	10'000	84'000 JPY	114.86%	663'846.22	0.07	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	55'000	0	0	55'000 JPY	112.41%	425'397.08	0.04	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	50'000	5'000	0	55'000 JPY	107.55%	407'005.05	0.04	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	47'000	7'000	0	54'000 JPY	99.97%	371'455.86	0.04	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	84'000	20'000	0	104'000 JPY	73.38%	525'092.55	0.05	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	101'000	26'000	10'000	117'000 JPY	86.49%	696'269.65	0.07	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	98'000	34'000	20'000	112'000 JPY	83.42%	642'879.16	0.06	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	106'000	13'000	0	119'000 JPY	74.64%	611'119.37	0.06	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	171'000	35'000	30'000	176'000 JPY	74.43%	901'297.31	0.09	a)
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	113'000	77'000	12'000	178'000 JPY	79.74%	976'574.04	0.10	a)
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	0	132'000	0	132'000 JPY	86.99%	790'121.65	0.08	a)
<b>JPY</b>							<b>140'503'356.25</b>	<b>13.90</b>	
US912810EQ77	6.2500 % T 6 1/4 08/15/23	383	0	383	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	456	0	0	456 USD	103.91%	444'080.77	0.04	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	389	0	0	389 USD	107.89%	393'358.68	0.04	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	505	0	0	505 USD	105.42%	498'973.61	0.05	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	263	0	0	263 USD	113.50%	279'773.81	0.03	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	626	0	400	226 USD	109.19%	231'279.32	0.02	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	200	192	0	392 USD	106.66%	391'857.20	0.04	a)
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	0	436	0	436 USD	111.70%	456'464.74	0.05	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	200	0	0	200 USD	104.69%	196'236.72	0.02	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	0	337	0	337 USD	106.00%	334'804.45	0.03	a)
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	523	0	0	523 USD	94.13%	461'383.57	0.05	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	400	0	0	400 USD	102.95%	385'971.25	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	743	0	175	568 USD	106.00%	564'299.48	0.06	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	722	0	0	722 USD	104.48%	707'040.05	0.07	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	528	0	0	528 USD	107.56%	532'292.39	0.05	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	613	0	0	613 USD	104.19%	598'592.88	0.06	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	551	0	0	551 USD	98.00%	506'096.26	0.05	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	758	0	0	758 USD	102.72%	729'750.47	0.07	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	744	0	0	744 USD	109.22%	761'597.63	0.08	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	820	0	0	820 USD	104.30%	801'568.46	0.08	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	681	0	0	681 USD	95.88%	611'938.73	0.06	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	820	226	420	626 USD	87.28%	512'095.25	0.05	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	744	0	0	744 USD	86.94%	606'227.36	0.06	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	768	0	250	518 USD	85.00%	412'671.18	0.04	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	815	0	275	540 USD	81.42%	412'088.35	0.04	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	1'052	350	500	902 USD	81.20%	686'490.77	0.07	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	872	0	0	872 USD	86.13%	703'884.12	0.07	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	1'476	357	500	1'333 USD	82.66%	1'032'669.37	0.10	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	1'040	0	0	1'040 USD	93.03%	906'812.81	0.09	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	1'104	526	500	1'130 USD	94.67%	1'002'662.78	0.10	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	1'109	273	300	1'082 USD	92.75%	940'581.92	0.09	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	964	0	0	964 USD	89.17%	805'675.96	0.08	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	1'210	189	0	1'399 USD	85.50%	1'121'086.90	0.11	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	843	644	522	965 USD	83.64%	756'484.45	0.07	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	1'306	397	0	1'703 USD	76.38%	1'219'049.44	0.12	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	406	250	0	656 USD	83.45%	513'099.83	0.05	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	1'048	0	170	878 USD	81.53%	670'925.15	0.07	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	600	371	491	480 USD	83.34%	374'946.86	0.04	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	1'046	309	0	1'355 USD	76.00%	965'180.05	0.10	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	810	300	0	1'110 USD	75.97%	790'339.00	0.08	a)
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	1'042	499	0	1'541 USD	72.13%	1'041'703.00	0.10	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	691	324	150	865 USD	81.47%	660'484.47	0.07	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	1'230	484	350	1'364 USD	83.22%	1'063'875.99	0.11	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	1'010	450	500	960 USD	83.28%	749'331.38	0.07	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'326	533	258	1'601 USD	79.50%	1'192'927.11	0.12	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'370	522	350	1'542 USD	79.53%	1'149'417.04	0.11	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	1'520	200	150	1'570 USD	83.36%	1'226'618.69	0.12	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	1'610	301	0	1'911 USD	85.38%	1'529'138.61	0.15	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	1'750	294	0	2'044 USD	83.45%	1'598'743.96	0.16	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	1'810	560	200	2'170 USD	89.47%	1'819'644.52	0.18	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	2'010	474	400	2'084 USD	83.66%	1'633'998.14	0.16	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	1'998	495	300	2'193 USD	81.73%	1'679'959.66	0.17	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	1'750	288	0	2'038 USD	71.72%	1'369'910.96	0.14	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	1'850	624	500	1'974 USD	73.77%	1'364'760.97	0.13	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	2'213	188	150	2'251 USD	67.63%	1'426'718.27	0.14	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'580	927	570	2'937 USD	55.48%	1'527'320.33	0.15	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	2'950	343	250	3'043 USD	57.34%	1'635'473.42	0.16	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	2'190	364	250	2'304 USD	62.92%	1'358'750.18	0.13	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	1'740	500	450	1'790 USD	63.27%	1'061'393.07	0.10	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	4'000	541	1'400	3'141 USD	61.28%	1'804'060.10	0.18	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	2'390	514	500	2'404 USD	65.64%	1'478'980.97	0.15	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	4'012	448	971	3'489 USD	65.31%	2'135'761.37	0.21	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	3'856	275	1'150	2'981 USD	71.41%	1'995'049.39	0.20	a)
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	2'485	868	0	3'353 USD	73.44%	2'307'846.33	0.23	a)
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'500	0	0	2'500 USD	75.94%	1'779'310.55	0.18	a)
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	2'500	966	0	3'466 USD	67.23%	2'184'114.55	0.22	a)
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	1'300	2'059	0	3'359 USD	69.25%	2'180'144.25	0.22	a)
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	1'400	1'953	339	3'014 USD	65.06%	1'837'932.02	0.18	a)
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	1'000	1'947	0	2'947 USD	72.19%	1'993'873.44	0.20	a)
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	1'000	2'161	210	2'951 USD	71.33%	1'972'810.80	0.20	a)
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	0	2'298	0	2'298 USD	76.91%	1'656'407.20	0.16	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	0	2'692	0	2'692 USD	81.91%	2'066'557.76	0.20	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	0	2'155	0	2'155 USD	88.36%	1'784'659.56	0.18	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	0	2'825	0	2'825 USD	84.13%	2'227'403.91	0.22	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	0	1'903	0	1'903 USD	90.00%	1'605'228.08	0.16	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	0	2'775	120	2'655 USD	101.75%	2'531'945.73	0.25	a)
US912810TM09	4.0000 % T 4 11/15/42	0	1'909	0	1'909 USD	98.56%	1'763'490.36	0.17	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	3'160	0	0	3'160 USD	90.75%	2'687'751.83	0.27	a)
US9128282D10	1.3750 % T 1 3/8 08/31/23	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	1'722	0	0	1'722 USD	95.97%	1'548'882.37	0.15	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	1'550	582	0	2'132 USD	91.91%	1'836'486.31	0.18	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	1'560	0	0	1'560 USD	95.39%	1'394'715.79	0.14	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	1'980	0	0	1'980 USD	95.67%	1'775'435.69	0.18	a)
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	1'750	0	0	1'750 USD	95.67%	1'569'198.22	0.16	a)
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	2'026	600	300	2'326 USD	91.63%	1'997'464.86	0.20	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	1'050	0	0	1'050 USD	95.34%	938'289.77	0.09	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	1'970	0	0	1'970 USD	95.41%	1'761'564.31	0.17	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	2'110	0	0	2'110 USD	95.77%	1'893'858.51	0.19	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	3'330	995	1'800	2'525 USD	93.55%	2'213'839.54	0.22	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	1'610	0	0	1'610 USD	96.11%	1'450'264.12	0.14	a)
US9128284A52	2.6250 % T 2 5/8 02/28/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284D91	2.5000 % T 2 1/2 03/31/23	2'250	0	2'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	521	211	0	732 USD	95.81%	657'337.94	0.07	a)
US9128284L18	2.7500 % T 2 3/4 04/30/23	1'250	0	1'250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	1'500	740	1'000	1'240 USD	96.16%	1'117'518.32	0.11	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	3'500	0	800	2'700 USD	93.88%	2'375'577.28	0.23	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	950	0	0	950 USD	96.09%	855'606.74	0.08	a)
US9128284S60	2.7500 % T 2 3/4 05/31/23	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284U17	2.6250 % T 2 5/8 06/30/23	1'550	0	1'550	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	3'500	517	900	3'117 USD	93.69%	2'736'994.36	0.27	a)
US9128284X55	2.7500 % T 2 3/4 08/31/23	1'350	0	1'350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	950	0	0	950 USD	95.59%	851'154.81	0.08	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	950	0	0	950 USD	96.13%	855'884.98	0.08	a)
US9128285D82	2.8750 % T 2 7/8 09/30/23	1'600	0	1'600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	850	0	0	850 USD	96.05%	765'169.48	0.08	a)
US9128285K26	2.8750 % T 2 7/8 10/31/23	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	2'850	470	600	2'720 USD	94.77%	2'415'878.90	0.24	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	1'650	0	0	1'650 USD	95.72%	1'480'254.58	0.15	a)
US9128285P13	2.8750 % T 2 7/8 11/30/23	1'500	0	0	1'500 USD	98.39%	1'383'249.20	0.14	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	1'300	0	0	1'300 USD	95.06%	1'158'265.27	0.11	a)
US9128285U08	2.6250 % T 2 5/8 12/31/23	1'950	0	0	1'950 USD	98.00%	1'791'084.75	0.18	a)
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	2'000	0	0	2'000 USD	97.64%	1'830'273.42	0.18	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	1'400	0	0	1'400 USD	94.94%	1'245'722.41	0.12	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	3'100	0	259	2'841 USD	92.05%	2'450'957.36	0.24	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	1'200	0	0	1'200 USD	94.50%	1'062'841.50	0.11	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	1'800	0	0	1'800 USD	97.30%	1'641'447.01	0.16	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	1'200	0	0	1'200 USD	93.72%	1'054'054.78	0.10	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	2'250	0	0	2'250 USD	96.75%	2'040'276.09	0.20	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	1'500	0	0	1'500 USD	93.94%	1'320'643.83	0.13	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	2'363	240	256	2'347 USD	90.47%	1'990'064.39	0.20	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	1'400	0	0	1'400 USD	93.05%	1'220'914.64	0.12	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	1'950	0	0	1'950 USD	95.70%	1'749'106.11	0.17	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	1'000	0	0	1'000 USD	92.27%	864'759.52	0.09	a)
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	2'485	0	0	2'485 USD	97.75%	2'276'662.26	0.23	a)
US9128288D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	2'004	0	0	2'004 USD	96.20%	1'806'934.13	0.18	a)
US9128288G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	3'467	0	0	3'467 USD	95.64%	3'107'790.07	0.31	a)
US9128288J272	2.0000 % T 2 02/15/25	2'588	0	0	2'588 USD	94.77%	2'298'637.73	0.23	a)
US9128288K742	2.0000 % T 2 08/15/25	2'473	505	500	2'478 USD	93.94%	2'181'703.60	0.22	a)
US9128288M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	2'610	0	0	2'610 USD	94.16%	2'303'271.38	0.23	a)
US9128288P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	2'740	0	0	2'740 USD	92.09%	2'365'027.36	0.23	a)
US9128288P790	1.5000 % T 1 1/2 02/28/23	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128288Q293	1.5000 % T 1 1/2 03/31/23	1'730	0	1'730	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912828R283	1.6250 % T 1 5/8 04/30/23	1'760	0	1'760	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	2'930	700	0	3'630 USD	91.59%	3'116'218.60	0.31	a)
US912828R697	1.6250 % T 1 5/8 05/31/23	1'330	0	1'330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828S356	1.3750 % T 1 3/8 06/30/23	1'490	0	1'490	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828S927	1.2500 % T 1 1/4 07/31/23	1'480	0	1'480	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828T263	1.3750 % T 1 3/8 09/30/23	1'790	0	1'790	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828T917	1.6250 % T 1 5/8 10/31/23	1'410	0	1'410	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	2'960	0	0	2'960 USD	91.94%	2'550'585.29	0.25	a)
US912828U576	2.1250 % T 2 1/8 11/30/23	1'660	0	1'660	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828UN88	2.0000 % T 2 02/15/23	2'781	0	2'781	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	1'250	0	0	1'250 USD	97.69%	1'144'470.12	0.11	a)
US912828V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	1'700	0	0	1'700 USD	97.42%	1'552'247.17	0.15	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'130	0	0	2'130 USD	92.52%	1'846'928.64	0.18	a)
US912828VB32	1.7500 % T 1 3/4 05/15/23	2'660	0	2'660	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828VS66	2.5000 % T 2 1/2 08/15/23	2'281	0	2'281	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	1'430	0	0	1'430 USD	97.06%	1'300'897.14	0.13	a)
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	3'200	0	0	3'200 USD	96.80%	2'903'132.02	0.29	a)
US912828WE61	2.7500 % T 2 3/4 11/15/23	3'375	0	3'375	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	4'025	0	0	4'025 USD	96.92%	3'656'311.29	0.36	a)
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	1'410	0	0	1'410 USD	96.45%	1'274'649.68	0.13	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	3'030	0	600	2'430 USD	92.66%	2'110'262.31	0.21	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	3'096	1'429	2'000	2'525 USD	94.58%	2'238'244.41	0.22	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	1'940	0	0	1'940 USD	96.22%	1'749'511.85	0.17	a)
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	1'960	0	0	1'960 USD	95.97%	1'762'955.53	0.17	a)
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	750	0	0	750 USD	95.77%	673'172.46	0.07	a)
US912828Y610	2.7500 % T 2 3/4 07/31/23	1'750	0	1'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	920	0	0	920 USD	96.00%	827'779.20	0.08	a)
US912828Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	2'000	0	0	2'000 USD	95.44%	1'788'975.94	0.18	a)
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	1'700	0	0	1'700 USD	92.06%	1'466'854.83	0.15	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	2'100	0	0	2'100 USD	86.42%	1'700'977.05	0.17	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	1'000	0	0	1'000 USD	90.28%	846'161.02	0.08	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	2'000	0	0	2'000 USD	94.52%	1'771'695.30	0.18	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	1'500	0	0	1'500 USD	90.97%	1'278'906.91	0.13	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	1'600	0	0	1'600 USD	94.70%	1'420'167.99	0.14	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	1'000	0	0	1'000 USD	94.50%	885'701.25	0.09	a)
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	1'400	0	0	1'400 USD	90.78%	1'191'186.17	0.12	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	1'450	0	0	1'450 USD	87.00%	1'182'340.88	0.12	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	1'000	0	0	1'000 USD	90.69%	849'968.59	0.08	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	1'000	500	0	1'500 USD	94.31%	1'325'915.86	0.13	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	1'350	0	0	1'350 USD	91.03%	1'151'807.03	0.11	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	1'150	0	0	1'150 USD	94.56%	1'019'230.09	0.10	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	1'284	0	0	1'284 USD	93.73%	1'128'026.71	0.11	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	2'500	1'114	0	3'614 USD	89.86%	3'043'736.24	0.30	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	2'390	290	0	2'680 USD	84.89%	2'132'308.06	0.21	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	0	600	0	600 USD	88.50%	497'679.75	0.05	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	1'300	0	0	1'300 USD	93.03%	1'133'516.01	0.11	a)
US912828ZD51	0.5000 % T 0 1/2 03/15/23	1'716	0	1'716	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	1'500	0	0	1'500 USD	86.41%	1'214'763.87	0.12	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	2'000	0	0	2'000 USD	91.64%	1'717'803.42	0.17	a)
US912828ZH65	0.2500 % T 0 1/4 04/15/23	1'900	0	1'900	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	2'080	0	0	2'080 USD	91.09%	1'775'854.44	0.18	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'900	0	0	1'900 USD	85.73%	1'526'736.41	0.15	a)
US912828ZP81	0.1250 % T 0 1/8 05/15/23	1'500	0	1'500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	3'440	401	0	3'841 USD	79.06%	2'846'232.02	0.28	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	1'900	0	150	1'750 USD	85.44%	1'401'335.20	0.14	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	1'868	0	0	1'868 USD	90.58%	1'585'826.33	0.16	a)
US912828ZU76	0.2500 % T 0 1/4 06/15/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	2'200	0	200	2'000 USD	85.22%	1'597'425.47	0.16	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	1'500	509	0	2'009 USD	90.38%	1'701'702.73	0.17	a)
US912828ZY98	0.1250 % T 0 1/8 07/15/23	2'150	0	2'150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	2'122	0	0	2'122 USD	90.08%	1'791'513.74	0.18	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	1'324	592	0	1'916 USD	84.53%	1'517'987.67	0.15	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	4'500	458	345	4'613 USD	78.63%	3'399'378.80	0.34	a)
US91282CAF86	0.1250 % T 0 1/8 08/15/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	2'000	0	400	1'600 USD	84.80%	1'271'614.01	0.13	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'042	245	0	2'287 USD	89.81%	1'925'122.63	0.19	a)
US91282CAK71	0.1250 % T 0 1/8 09/15/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	1'500	844	319	2'025 USD	84.08%	1'595'744.91	0.16	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	2'000	602	0	2'602 USD	89.64%	2'186'087.76	0.22	a)
US91282CAP68	0.1250 % T 0 1/8 10/15/23	1'684	0	1'684	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	2'500	0	0	2'500 USD	89.28%	2'091'971.29	0.21	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	2'500	723	1'000	2'223 USD	84.38%	1'757'958.82	0.17	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	4'900	805	650	5'055 USD	79.91%	3'785'797.32	0.37	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	2'200	0	2'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	2'100	0	0	2'100 USD	84.72%	1'667'455.62	0.16	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'500	0	0	2'500 USD	89.33%	2'093'069.51	0.21	a)
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	2'000	0	0	2'000 USD	96.19%	1'803'034.69	0.18	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	2'400	0	0	2'400 USD	84.53%	1'901'445.94	0.19	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	2'900	1'347	1'200	3'047 USD	89.20%	2'547'463.37	0.25	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	3'048	0	0	3'048 USD	88.83%	2'537'586.66	0.25	a)
US91282CBI99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	3'350	0	546	2'804 USD	84.86%	2'230'146.09	0.22	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	5'322	1'323	1'500	5'145 USD	81.36%	3'923'272.36	0.39	a)
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	2'600	0	0	2'600 USD	95.30%	2'322'242.02	0.23	a)
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'152	0	0	3'152 USD	86.31%	2'549'854.23	0.25	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'217	0	0	3'217 USD	88.89%	2'680'170.64	0.27	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	2'250	0	0	2'250 USD	95.08%	2'005'019.28	0.20	a)
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	3'607	731	2'000	2'338 USD	86.69%	1'899'574.95	0.19	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	2'890	0	0	2'890 USD	89.47%	2'423'397.54	0.24	a)
US91282CBU45	0.1250 % T 0 1/8 03/31/23	2'750	0	2'750	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	0	1'600	0	1'600 USD	94.84%	1'422'276.88	0.14	a)
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	0	1'000	0	1'000 USD	89.14%	835'470.46	0.08	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	3'600	0	500	3'100 USD	86.50%	2'513'235.88	0.25	a)
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	4'350	688	160	4'878 USD	84.06%	3'843'258.06	0.38	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	0	900	0	900 USD	94.31%	795'549.52	0.08	a)
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	3'000	0	0	3'000 USD	86.36%	2'428'209.87	0.24	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	1'000	1'487	0	2'487 USD	88.91%	2'072'352.01	0.20	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	0	2'000	0	2'000 USD	93.95%	1'761'151.23	0.17	a)
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	2'500	0	0	2'500 USD	86.17%	2'019'114.86	0.20	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'000	0	0	2'000 USD	89.13%	1'670'648.13	0.17	a)
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	0	1'100	0	1'100 USD	93.77%	966'700.10	0.10	a)
US91282CCN92	0.1250 % T 0 1/8 07/31/23	2'000	0	2'000	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'000	0	0	2'000 USD	88.09%	1'651'317.34	0.16	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	1'400	1'539	0	2'939 USD	84.81%	2'336'226.26	0.23	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	4'250	1'388	260	5'378 USD	81.06%	4'085'980.04	0.40	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	0	2'000	0	2'000 USD	93.45%	1'751'778.73	0.17	a)
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	0	2'600	0	2'600 USD	85.23%	2'077'033.99	0.21	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	0	2'665	0	2'665 USD	88.25%	2'204'283.13	0.22	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	0	600	0	600 USD	93.17%	523'952.07	0.05	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	700	2'255	0	2'955 USD	85.64%	2'371'880.13	0.23	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	0	2'154	0	2'154 USD	88.45%	1'785'723.87	0.18	a)
US91282CDA62	0.2500 % T 0 1/4 09/30/23	1'200	0	1'200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	0	2'000	0	2'000 USD	93.25%	1'747'971.25	0.17	a)
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	1'500	1'200	0	2'700 USD	86.09%	2'178'666.91	0.22	a)
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	0	1'928	0	1'928 USD	89.06%	1'609'375.41	0.16	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	0	1'761	0	1'761 USD	93.17%	1'537'799.32	0.15	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	4'500	906	290	5'116 USD	81.39%	3'902'656.63	0.39	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	0	2'591	0	2'591 USD	89.31%	2'168'877.93	0.21	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	2'200	338	0	2'538 USD	86.59%	2'059'840.61	0.20	a)
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	0	1'982	0	1'982 USD	93.33%	1'733'690.69	0.17	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	1'000	1'781	0	2'781 USD	85.91%	2'239'139.75	0.22	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CDQ15	1.2500 % T 1 1/4 12/31/26	0	2'666	0	2'666 USD	89.16%	2'227'754.80	0.22	a)
US91282CDR97	0.7500 % T 0 3/4 12/31/23	0	660	0	660 USD	96.48%	596'837.88	0.06	a)
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	0	1'670	0	1'670 USD	93.36%	1'461'268.02	0.14	a)
US91282CDV00	0.8750 % T 0 7/8 01/31/24	0	700	0	700 USD	96.19%	631'062.14	0.06	a)
US91282CDW82	1.7500 % T 1 3/4 01/31/29	1'000	1'184	0	2'184 USD	87.56%	1'792'364.10	0.18	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	500	4'691	280	4'911 USD	84.72%	3'899'464.06	0.39	a)
US91282CDZ14	1.5000 % T 1 1/2 02/15/25	0	2'439	0	2'439 USD	93.83%	2'144'866.49	0.21	a)
US91282CEA53	1.5000 % T 1 1/2 02/29/24	0	800	0	800 USD	96.47%	723'322.69	0.07	a)
US91282CEB37	1.8750 % T 1 7/8 02/28/29	0	2'212	0	2'212 USD	88.20%	1'828'624.43	0.18	a)
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	0	2'200	0	2'200 USD	91.06%	1'877'663.22	0.19	a)
US91282CED92	1.7500 % T 1 3/4 03/15/25	0	2'252	0	2'252 USD	94.09%	1'986'024.55	0.20	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	0	2'241	0	2'241 USD	90.63%	1'903'466.88	0.19	a)
US91282CEF41	2.5000 % T 2 1/2 03/31/27	0	2'126	0	2'126 USD	93.25%	1'858'093.44	0.18	a)
US91282CEG24	2.2500 % T 2 1/4 03/31/24	0	1'000	0	1'000 USD	96.94%	908'546.72	0.09	a)
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	0	2'000	0	2'000 USD	95.69%	1'793'662.19	0.18	a)
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	0	1'800	0	1'800 USD	93.22%	1'572'646.92	0.16	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	0	2'000	0	2'000 USD	94.11%	1'764'080.33	0.17	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	0	5'170	456	4'714 USD	91.98%	4'064'050.65	0.40	a)
US91282CEQ06	2.7500 % T 2 3/4 05/15/25	0	2'000	0	2'000 USD	95.86%	1'796'884.08	0.18	a)
US91282CER88	2.5000 % T 2 1/2 05/31/24	0	2'000	0	2'000 USD	96.81%	1'814'750.31	0.18	a)
US91282CES61	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	0	1'964	0	1'964 USD	92.50%	1'702'702.08	0.17	a)
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	0	1'693	0	1'693 USD	93.58%	1'484'864.15	0.15	a)
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	0	2'205	0	2'205 USD	96.09%	1'985'908.27	0.20	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	0	1'760	0	1'760 USD	95.16%	1'569'659.44	0.16	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	0	2'239	0	2'239 USD	95.95%	2'013'578.86	0.20	a)
US91282CEY30	3.0000 % T 3 07/15/25	0	2'158	0	2'158 USD	96.28%	1'947'370.61	0.19	a)
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	0	2'249	0	2'249 USD	93.94%	1'980'085.32	0.20	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	0	1'871	0	1'871 USD	91.69%	1'607'827.19	0.16	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	0	2'109	0	2'109 USD	96.53%	1'908'094.85	0.19	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	0	4'496	0	4'496 USD	90.88%	3'829'359.82	0.38	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	0	2'115	0	2'115 USD	95.44%	1'891'842.06	0.19	a)
US91282CFJ53	3.1250 % T 3 1/8 08/31/29	0	1'673	0	1'673 USD	94.42%	1'480'553.25	0.15	a)
US91282CFK27	3.5000 % T 3 1/2 09/15/25	0	1'893	0	1'893 USD	97.38%	1'727'641.13	0.17	a)
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	0	1'968	218	1'750 USD	98.66%	1'618'147.49	0.16	a)
US91282CFM82	4.1250 % T 4 1/8 09/30/27	0	2'104	0	2'104 USD	99.48%	1'961'806.11	0.19	a)
US91282CFP14	4.2500 % T 4 1/4 10/15/25	0	1'847	0	1'847 USD	99.16%	1'716'494.59	0.17	a)
US91282CFQ96	4.3750 % T 4 3/8 10/31/24	0	1'980	0	1'980 USD	99.05%	1'838'067.42	0.18	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	0	1'670	0	1'670 USD	99.41%	1'555'914.09	0.15	a)
US91282CFU09	4.1250 % T 4 1/8 10/31/27	0	1'892	0	1'892 USD	99.50%	1'764'410.62	0.17	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	0	4'748	0	4'748 USD	101.61%	4'521'681.42	0.45	a)
US91282CFW64	4.5000 % T 4 1/2 11/15/25	0	1'487	0	1'487 USD	99.83%	1'391'295.27	0.14	a)
US91282CFX48	4.5000 % T 4 1/2 11/30/24	0	1'848	0	1'848 USD	99.28%	1'719'588.98	0.17	a)
US91282CFY21	3.8750 % T 3 7/8 11/30/29	0	1'583	0	1'583 USD	98.72%	1'464'657.27	0.14	a)
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	0	2'058	0	2'058 USD	98.58%	1'901'434.42	0.19	a)
US91282CGA36	4.0000 % T 4 12/15/25	0	1'481	0	1'481 USD	98.66%	1'369'415.09	0.14	a)
US91282CGB19	3.8750 % T 3 7/8 12/31/29	0	1'772	0	1'772 USD	98.77%	1'640'306.33	0.16	a)
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	0	2'087	0	2'087 USD	98.55%	1'927'617.13	0.19	a)
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	0	1'744	0	1'744 USD	98.88%	1'616'175.16	0.16	a)
US91282CGE57	3.8750 % T 3 7/8 01/15/26	0	896	0	896 USD	98.28%	825'342.35	0.08	a)
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	0	1'957	0	1'957 USD	98.70%	1'810'410.90	0.18	a)

**USD** **433'547'851.44** **42.88**

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

**433'778'508.31** **42.90**

**Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen**

**433'778'508.31** **42.90**

CH0302469082	SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVT. ST	169	80	31	218 AUD	103'053.02	14'187'740.81	1.40	a)
--------------	--------------------------------------	-----	----	----	---------	------------	---------------	------	----

**AUD** **14'187'740.81** **1.40**

CH0302468589	SWC (CH) INDEX BF CANADA GOVT. ST	212	99	43	268 CAD	97'185.80	17'906'104.15	1.77	a)
--------------	-----------------------------------	-----	----	----	---------	-----------	---------------	------	----

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>CAD</b>									
CH0302469108	SWC (CH) INDEX BF WORLD REST GOVT. ST CHF	312	85	34	363 CHF	88'116.36	31'970'200.01	3.16	a)
<b>CHF</b>									
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	59'966	223'254	10'544	272'675 CNY	1'048.33	38'539'788.63	3.81	a)
<b>CNY</b>									
CH0302432049	SWC (CH) INDEX BF AUSTRIA GOVT. ST EUR	105	39	18	126 EUR	82'610.23	10'360'420.49	1.02	a)
CH0302432064	SWC (CH) INDEX BF BELGIUM GOVT. ST EUR	165	47	19	193 EUR	84'151.66	16'101'773.99	1.59	a)
CH0302432072	SWC (CH) INDEX BF FINLAND GOVT. ST EUR	47	12	7	53 EUR	83'551.84	4'396'828.91	0.43	a)
CH0302432098	SWC (CH) INDEX BF FRANCE GOVT. ST EUR	741	340	215	866 EUR	85'817.67	73'887'884.54	7.31	a)
CH0302432130	SWC (CH) INDEX BF GERMANY GOVT. ST EUR	545	258	137	666 EUR	85'475.52	56'572'727.12	5.59	a)
CH0302432148	SWC (CH) INDEX BF IRELAND GOVT. ST EUR	59	16	10	65 EUR	86'083.59	5'537'224.39	0.55	a)
CH0302432163	SWC (CH) INDEX BF ITALY GOVT. ST EUR	632	257	168	720 EUR	91'650.10	65'625'345.84	6.49	a)
CH0302432171	SWC (CH) INDEX BF NETHERLANDS GOVT. ST EUR	136	46	25	157 EUR	83'010.89	12'944'109.46	1.28	a)
CH0302432254	SWC (CH) INDEX BF SPAIN GOVT. ST EUR	408	177	107	478 EUR	91'607.39	43'524'273.75	4.30	a)
<b>EUR</b>									
CH0215804458	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. NT GBP	0	9'679	9'679	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
CH0302468605	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. ST GBP	327	184	78	432 GBP	86'166.45	42'224'086.22	4.18	a)
<b>GBP</b>									
							<b>42'224'086.22</b>	<b>4.18</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-5'821'910.06</b>	<b>-0.58</b>	

#### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall	03.03.2022	396'570'238	425'898'000	CHF/USD	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall	03.03.2022	2'458'221	24'756'000	CHF/SEK	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall	03.03.2022	3'759'990	5'470'000	CHF/SGD	0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall	03.03.2022	6'029'988	134'938'000	CHF/MXN	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall	03.03.2022	2'068'447	19'933'000	CHF/NOK	0.00	0.00
PLN/CHF	Verfall	03.03.2022	4'091'710	18'124'000	CHF/PLN	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	03.03.2022	317'933'070	305'425'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall	03.03.2022	47'931'231	38'320'000	CHF/GBP	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	03.03.2022	162'849'843	20'186'187'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall	03.03.2022	16'597'115	22'677'000	CHF/CAD	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	03.03.2022	5'758'358	39'544'000	CHF/CNY	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall	03.03.2022	3'724'511	12'743'000	CHF/ILS	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall	03.03.2022	3'742'433	26'759'000	CHF/DKK	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	03.03.2022	12'672'801	19'294'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/DKK	Verfall	03.03.2022	205'000	28'609	DKK/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall	03.03.2022	891'000	1'109'896	GBP/CHF	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall	03.03.2022	135'806	207'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	03.03.2022	387'363'000	3'113'539	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall	03.03.2022	267'000	194'196	CAD/CHF	0.00	0.00
MXN/CHF	Verfall	03.03.2022	24'375	546'000	CHF/MXN	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	03.03.2022	5'260'000	5'460'785	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.03.2022	5'733'000	5'287'941	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.03.2022	1'676'727	1'816'000	CHF/USD	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	03.03.2022	1'690'797	11'675'000	CHF/CNY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.03.2022	3'186'491	3'434'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall	03.03.2022	3'144'325	391'642'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall	03.03.2022	2'883'210	2'763'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall	03.03.2022	1'518'000	10'333'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.03.2022	425'415'000	393'626'715	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/GBP	Verfall	03.03.2022	37'429'000	46'277'665	GBP/CHF	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall	03.03.2022	20'190'466'000	161'629'122	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall	03.03.2022	24'756'000	2'401'654	SEK/CHF	0.00	0.00
CHF/PLN	Verfall	03.03.2022	18'124'000	3'989'473	PLN/CHF	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall	03.03.2022	19'933'000	2'071'696	NOK/CHF	0.00	0.00
CHF/SGD	Verfall	03.03.2022	5'470'000	3'726'060	SGD/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	03.03.2022	302'928'000	313'276'626	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall	03.03.2022	19'501'000	12'988'427	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall	03.03.2022	22'410'000	16'230'936	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/CNY	Verfall	03.03.2022	61'552'000	9'029'186	CNY/CHF	0.00	0.00
CHF/DKK	Verfall	03.03.2022	26'554'000	3'691'351	DKK/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/ILS Verfall 03.03.2022		12'743'000	3'620'210		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.03.2022		135'484'000	6'094'558		MXN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.04.2022		386'557'090	418'480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.04.2022		45'515'760	36'862'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.04.2022		160'221'796	20'029'402'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.04.2022		2'369'108	24'449'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.04.2022		3'952'121	18'043'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.04.2022		2'055'241	19'817'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.04.2022		3'694'919	5'434'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.04.2022		306'790'469	296'764'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.04.2022		12'729'583	19'138'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.04.2022		16'017'904	22'153'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.04.2022		3'590'497	25'851'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.04.2022		3'545'901	12'509'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.04.2022		5'999'158	134'475'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2022		41'000	50'279		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.04.2022		2'063'166	257'812'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.04.2022		7'389'916	8'049'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.04.2022		91'472	126'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.04.2022		250'000	23'674		SEK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.04.2022		2'339'604	2'291'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.04.2022		292'000	198'138		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.04.2022		289'000	39'682		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.04.2022		850'000	182'029		PLN/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.04.2022		54'678	192'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.04.2022		24'740	37'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.04.2022		120'475	1'166'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2022		292'000	269'202		USD/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.04.2022		161'296	3'656'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2022		351'000	322'111		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.04.2022		19'931'000	159'409		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2022		323'000	299'124		USD/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.04.2022		37'296	174'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.04.2022		63'000	42'962		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.04.2022		584'000	25'693		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.04.2022		100'000	28'477		ILS/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.04.2022		21'983	212'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.04.2022		1'993'000	276'740		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.04.2022		1'715'000	179'072		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2022		24'819'000	23'351'527		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.04.2022		1'155'680'000	9'203'836		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.04.2022		1'547'000	337'181		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.04.2022		12'253'000	550'220		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.04.2022		1'100'000	808'330		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.04.2022		1'003'000	288'057		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2022		2'999'000	3'686'881		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.04.2022		2'049'000	200'597		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.04.2022		357'000	245'880		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2022		16'154'000	16'688'988		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.04.2022		1'043'000	706'346		AUD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.04.2022		804'688	783'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.04.2022		1'732'707	1'859'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2022		402'603'000	372'584'518		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.04.2022		33'822'000	41'108'747		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.04.2022		19'111'603'000	145'145'553		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.04.2022		283'684'000	292'418'063		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.04.2022		18'132'000	12'544'062		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.04.2022		23'569'000	3'266'687		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.04.2022		21'179'000	15'653'865		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.04.2022		125'294'000	5'843'274		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.04.2022		19'480'000	2'073'003		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.04.2022		15'820'000	3'511'249		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.04.2022		22'150'000	2'208'997		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.04.2022		4'722'000	3'228'238		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.04.2022		8'951'249	61'286'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.05.2022		359'310'929	388'701'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.05.2022		40'032'429	32'977'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.05.2022		284'033'564	275'601'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.05.2022		11'891'602	17'201'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.05.2022		3'132'581	22'606'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.05.2022		15'056'654	20'396'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.05.2022		5'726'703	123'594'000		CHF/MXN	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	NOK/CHF Verfall 05.05.2022		2'014'583	18'959'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.05.2022		3'345'125	15'132'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.05.2022		2'109'564	21'164'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.05.2022		3'095'187	4'533'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.05.2022		38'289	825'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.05.2022		7'096'672	7'671'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.05.2022		880'177	726'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.05.2022		15'661	114'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.05.2022		3'618'442	3'541'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.05.2022		104'312	141'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.05.2022		45'750	66'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.05.2022		23'144	34'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.05.2022		39'017	178'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.05.2022		1'747'505	1'871'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.05.2022		509'867	503'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.05.2022		505'402	730'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.05.2022		408'817	553'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.05.2022		445'000	426'524		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.05.2022		700'000	718'582		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.05.2022		397'798'000	385'438'814		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.05.2022		33'703'000	40'997'778		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.05.2022		277'686'000	284'212'732		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.05.2022		21'090'000	16'054'172		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.05.2022		17'116'000	11'875'235		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.05.2022		21'164'000	2'102'368		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.05.2022		15'310'000	3'361'157		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.05.2022		22'720'000	3'126'045		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.05.2022		124'419'000	5'923'253		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.05.2022		18'959'000	1'978'030		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.05.2022		881'000	607'738		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.05.2022		1'259'000	1'289'308		EUR/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.05.2022		143'005'035	18'839'853'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.05.2022		8'913'256	61'370'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.05.2022		3'271'228	11'234'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.05.2022		61'256	212'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.05.2022		1'557'465	206'729'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.05.2022		2'199'996	15'175'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.05.2022		11'446'000	3'339'725		ILS/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.06.2022		1'006'160	1'050'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.06.2022		374'459'829	387'103'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.06.2022		40'140'753	33'053'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.06.2022		12'767'239	87'568'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.06.2022		276'661'725	270'357'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.06.2022		141'142'887	18'917'270'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.06.2022		15'588'815	20'515'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.06.2022		11'693'765	16'873'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.06.2022		2'077'564	20'932'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 08.06.2022		3'222'237	14'766'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.06.2022		3'211'534	4'577'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.06.2022		3'034'827	22'062'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.06.2022		3'302'186	11'326'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 08.06.2022		5'697'310	120'696'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 08.06.2022		1'976'512	18'975'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.06.2022		265'463'000	1'991'498		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.06.2022		454'000	554'704		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.06.2022		9'319'000	9'093'928		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.06.2022		56'000	38'536		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.06.2022		5'251'000	5'412'353		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 08.06.2022		789'000	81'855		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.06.2022		1'070'000	106'181		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.06.2022		308'000	88'847		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 08.06.2022		888'000	195'505		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.06.2022		5'519'000	267'340		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 08.06.2022		146'000	103'754		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 08.06.2022		973'000	135'687		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.06.2022		151'000	105'155		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.06.2022		235'000	289'045		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.06.2022		1'404'000	1'467'685		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.06.2022		112'000	87'082		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.06.2022		650'000	192'678		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.06.2022		1'702'000	1'682'880		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 08.06.2022		220'000	49'198		PLN/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	SGD/CHF Verfall 08.06.2022		44'915	63'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.06.2022		60'128'000	463'013		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.06.2022		1'100'000	54'216		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 08.06.2022		685'141	4'774'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.06.2022		1'521'335	1'480'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.06.2022		3'452'241	3'588'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.06.2022		1'489'090	197'053'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 08.06.2022		18'788'732'000	141'430'489		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.06.2022		379'670'000	364'756'562		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.06.2022		265'182'000	273'708'397		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.06.2022		32'364'000	39'242'030		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 08.06.2022		20'403'000	15'462'618		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 08.06.2022		114'077'000	5'585'803		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 08.06.2022		16'666'000	11'500'790		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 08.06.2022		21'089'000	2'926'310		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 08.06.2022		92'342'000	13'288'198		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 08.06.2022		13'658'000	3'072'108		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 08.06.2022		10'368'000	2'977'379		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 08.06.2022		18'186'000	1'847'261		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 08.06.2022		19'862'000	1'944'450		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 08.06.2022		4'494'000	3'150'573		SGD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2022		141'447'426	18'798'474'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2022		365'431'744	380'968'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2022		268'714'589	260'371'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2022		38'719'282	31'978'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.07.2022		15'462'287	20'437'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2022		5'742'422	118'133'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.07.2022		11'414'086	16'559'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2022		2'922'003	21'061'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2022		13'381'065	93'229'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.07.2022		3'115'608	13'926'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.07.2022		2'951'254	10'297'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.07.2022		1'869'982	18'434'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2022		2'019'531	20'642'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.07.2022		3'178'864	4'542'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		256'158'000	1'898'886		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2022		112'000	77'478		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.07.2022		381'000	52'648		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2022		560'000	27'124		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2022		1'167'341	8'129'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2022		104'000	79'096		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2022		63'000	60'605		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2022		748'000	899'552		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2022		6'298'000	6'473'966		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.07.2022		2'559'000	262'095		NOK/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.07.2022		74'893	106'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.07.2022		226'155	4'585'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.07.2022		1'337'727	1'125'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.07.2022		7'094'101	6'972'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.07.2022		46'123	66'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.07.2022		105'865	774'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.07.2022		28'087	296'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2022		10'660'081	11'007'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.07.2022		137'779	644'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.07.2022		584'654	4'057'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.07.2022		118'930	425'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.07.2022		3'185'742	435'697'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2022		1'210'000	56'520		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2022		7'103'000	6'840'090		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2022		416'000	310'083		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2022		787'000	931'123		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		373'110'000	2'641'339		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2022		365'000	52'561		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2022		4'647'000	4'731'575		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		57'382'000	408'860		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2022		1'626'000	1'557'036		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.07.2022		863'000	869'233		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		67'419'000	473'952		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2022		307'000	203'505		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2022		347'000	257'998		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		316'571'000	2'204'509		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2022		383'183'000	365'837'072		USD/CHF	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 06.07.2022		255'535'000	255'034'407		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.07.2022		31'568'000	36'617'554		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		18'163'531'000	127'372'669		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.07.2022		16'140'000	10'613'583		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.07.2022		19'570'000	14'476'066		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.07.2022		10'722'000	2'944'980		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.07.2022		4'714'000	3'235'020		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.07.2022		15'875'000	1'531'271		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.07.2022		14'570'000	3'118'315		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.07.2022		105'050'000	14'978'659		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.07.2022		21'454'000	2'877'475		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.07.2022		20'938'000	1'955'211		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.07.2022		120'948'000	5'727'964		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2022		12'042'127	11'600'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.07.2022		336'610'612	2'400'000		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2022		357'816'153	375'457'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2022		246'169'777	246'629'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2022		35'174'716	30'363'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2022		124'973'235	17'822'893'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2022		10'345'679	15'758'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2022		13'995'783	18'956'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.08.2022		2'900'374	10'574'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2022		3'159'368	4'612'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2022		1'515'369	15'732'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2022		3'028'113	14'234'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2022		14'930'126	104'954'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2022		2'751'068	20'510'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2022		1'913'658	20'513'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2022		5'572'333	118'528'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2022		162'177	218'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2022		16'826'510	17'502'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2022		763'790	1'173'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2022		2'925'476	410'429'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2022		1'896'198	1'642'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2022		62'698	466'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2022		11'439'999	11'428'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2022		2'221'258	15'504'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.08.2022		116'482	1'266'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.08.2022		85'344	639'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.08.2022		60'348	629'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 04.08.2022		225'520	1'088'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2022		5'838'212	818'571'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.08.2022		164'421	598'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2022		11'963'877	12'039'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2022		503'387	767'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2022		17'201'298	17'761'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2022		1'646'237	1'426'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.08.2022		369'231	7'887'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2022		581'814	4'039'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.08.2022		203'169	295'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2022		1'497'935	2'018'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.08.2022		5'349'994	761'701'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.08.2022		395'455	527'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2022		15'123'976	15'632'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 04.08.2022		1'084'240	7'562'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2022		1'000'336	859'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.08.2022		197'090	295'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.08.2022		8'883'535	8'952'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.08.2022		1'278'999	1'101'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.08.2022		16'361'000	1'611'199		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.08.2022		126'415'000	5'945'437		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.08.2022		21'615'000	2'830'765		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 04.08.2022		132'059'000	18'667'068		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.08.2022		17'993'000	12'039'728		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.08.2022		4'907'000	3'391'336		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.08.2022		11'172'000	3'137'042		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.08.2022		21'779'000	2'045'897		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.08.2022		21'719'000	16'159'131		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 04.08.2022		15'322'000	3'146'786		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.08.2022		19'813'594'000	142'127'071		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.08.2022		35'391'000	41'169'430		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.08.2022		279'048'000	272'084'915		EUR/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 04.08.2022		426'352'000	406'122'450		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 31.08.2022		2'200'000	313'575'689		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.08.2022		7'400'000	7'684'336		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 06.09.2022		1'626'537	16'547'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2022		5'971'915	128'112'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 06.09.2022		2'948'611	22'520'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2022		18'761'262	133'002'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2022		12'365'522	18'516'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 06.09.2022		3'437'483	4'986'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.09.2022		3'168'443	11'304'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 06.09.2022		2'075'365	22'116'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2022		16'517'120	22'257'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2022		3'253'508	15'992'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2022		143'324'222	19'981'851'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2022		40'657'405	35'012'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2022		278'058'747	285'230'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2022		408'164'450	429'555'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 06.09.2022		164'812	3'570'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.09.2022		189'000	130'268		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 06.09.2022		1'807'788	12'852'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 06.09.2022		779'903	107'736'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 06.09.2022		644'554	554'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 06.09.2022		68'546	335'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.09.2022		560'469	847'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 06.09.2022		5'453'963	5'607'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.09.2022		3'765'129	3'957'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.09.2022		933'448	1'262'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.09.2022		552'000	409'156		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2022		311'740'000	2'187'455		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2022		7'846'000	7'553'737		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2022		5'235'000	5'050'414		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.09.2022		565'000	641'516		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2022		2'920'000	2'846'279		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2022		156'838'000	1'101'688		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.09.2022		424'850'000	414'734'322		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 06.09.2022		282'682'000	276'436'424		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 06.09.2022		35'001'000	39'801'212		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 06.09.2022		19'602'000'000	137'985'143		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 06.09.2022		145'854'000	20'619'234		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 06.09.2022		22'967'000	17'118'499		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 06.09.2022		19'363'000	12'993'038		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 06.09.2022		22'520'000	2'959'984		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 06.09.2022		16'547'000	1'635'820		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 06.09.2022		22'116'000	2'022'331		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 06.09.2022		131'682'000	6'366'021		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 06.09.2022		16'327'000	3'378'448		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 06.09.2022		4'797'000	3'350'992		SGD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.10.2022		404'755'110	415'613'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.10.2022		264'763'059	270'864'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.10.2022		37'225'932	32'795'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.10.2022		137'387'566	19'516'804'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.10.2022		16'646'553	22'393'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.10.2022		12'458'838	18'603'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.10.2022		2'845'890	21'663'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.10.2022		1'591'414	16'128'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.10.2022		1'965'051	21'511'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.10.2022		6'248'890	130'334'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.10.2022		3'264'772	15'893'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.10.2022		3'291'907	4'723'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.10.2022		62'214	302'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.10.2022		135'218	193'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.10.2022		164'000	21'571		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.10.2022		6'992'000	6'839'574		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.10.2022		117'380'000	825'674		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.10.2022		4'807'000	4'723'478		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.10.2022		38'000	28'329		CAD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.10.2022		82'649	124'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.10.2022		29'567	613'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.10.2022		1'453'000	1'646'656		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.10.2022		611'000	599'816		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.10.2022		746'000	499'489		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.10.2022		150'454'000	1'002'637		JPY/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/CAD Verfall 05.10.2022		680'000	497'537		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.10.2022		3'289'000	3'155'654		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.10.2022		1'285'000	1'236'477		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.10.2022		93'000	103'058		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.10.2022		56'051'000	383'311		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.10.2022		163'000	161'244		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.10.2022		4'916'000	3'356'311		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.10.2022		407'354'000	397'857'764		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.10.2022		16'195'000	3'208'165		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.10.2022		21'511'000	1'894'022		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.10.2022	19'192'919'000		129'881'170		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.10.2022		31'249'000	34'134'876		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.10.2022		261'976'000	251'948'345		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.10.2022		21'675'000	15'486'809		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.10.2022		16'128'000	1'473'373		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.10.2022		130'947'000	6'355'369		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.10.2022		21'499'000	2'779'842		DKK/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.10.2022		3'260'703	11'134'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.10.2022		734'000	212'640		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		20'734'553	147'064'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 11.10.2022		15'627	110'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2022		3'259'217	4'785'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2022		385'382'957	395'592'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2022		3'100'574	15'764'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.11.2022		1'885'286	21'441'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2022		30'704'063	28'163'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2022		241'898'088	251'666'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.11.2022		2'828'087	10'260'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.11.2022		15'517'491	21'776'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2022		1'457'381	15'989'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2022		6'131'852	127'377'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2022		11'041'605	17'416'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.11.2022		2'663'571	20'613'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2022		20'177'081	146'877'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2022		193'000	26'889		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2022		112'000	80'997		CAD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.11.2022		4'014'443	4'130'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.11.2022		73'000	14'625		PLN/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.11.2022		805'279	815'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.11.2022		159'941	249'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.11.2022		306'704	275'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2022		3'035'848	21'770'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.11.2022		121'000	15'939		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2022		313'000	28'052		SEK/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.11.2022		14'705	72'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.11.2022		16'078	23'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.11.2022		26'729	284'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.11.2022		154'000	43'499		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.11.2022		717'000	35'524		MXN/CHF	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.11.2022		19'872	396'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.11.2022		38'000	10'733		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.11.2022		1'498'681	10'960'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.11.2022		17'665'000	11'300'866		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.11.2022		179'414'000	24'513'335		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.11.2022		255'796'000	253'922'550		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.11.2022		28'438'000	32'854'080		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.11.2022		21'664'000	15'882'593		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.11.2022		20'492'000	2'733'571		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2022		396'100'000	396'188'726		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.11.2022		10'068'000	2'847'532		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.11.2022		21'128'000	1'922'585		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.11.2022		4'808'000	3'399'564		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.11.2022		16'273'000	1'572'069		NOK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.11.2022		127'194'933	18'793'522'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.11.2022		699'397	101'981'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.11.2022	18'865'503'000		127'205'370		JPY/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2022		11'329'976	17'759'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2022		24'564'063	180'099'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.12.2022		256'624'896	258'833'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.12.2022		33'933'258	29'449'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2022		2'879'074	13'782'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.12.2022		15'756'043	21'562'000		CHF/CAD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 05.12.2022		2'597'806	19'495'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.12.2022		126'043'607	18'691'403'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.12.2022		1'480'891	2'559'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.12.2022		391'972'521	393'264'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2022		2'723'990	9'649'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.12.2022		1'832'848	20'172'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2022		6'103'977	122'236'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2022		3'272'664	4'644'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.12.2022		1'477'919	15'337'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2022		85'000	62'109	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.12.2022		193'000	25'567	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.12.2022		255'000	53'162	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2022		528'000	26'513	MXN/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.12.2022		81'558	128'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.12.2022		40'217	294'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2022		286'415'000	1'933'152	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2022		83'000	94'846	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.12.2022		127'000	11'499	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2022		9'721'000	9'683'574	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2022		8'910'000	8'782'400	EUR/CHF		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.12.2022		115'097	868'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.12.2022		49'252	84'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.12.2022		261'259	5'152'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.12.2022		137'225	194'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.12.2022		118'749	566'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.12.2022		86'648	953'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.12.2022		45'688	472'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.12.2022		70'469	251'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.12.2022		333'000	43'996	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.12.2022		29'366'000	33'465'435	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.12.2022		383'543'000	364'527'322	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.12.2022		18'404'988'000	126'230'794	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.12.2022		249'923'000	246'329'107	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.12.2022		180'393'000	24'070'920	CNY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.12.2022		17'887'000	11'429'793	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.12.2022		21'477'000	15'074'341	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.12.2022		15'809'000	1'513'222	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.12.2022		19'837'000	2'629'950	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.12.2022		20'998'000	1'895'363	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 05.12.2022		2'643'000	1'567'365	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.12.2022		126'860'000	6'272'745	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.12.2022		14'093'000	2'969'550	PLN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.12.2022		4'838'000	3'359'686	SGD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 29.12.2022		800'000	113'701'774	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.12.2022		1'400'000	1'504'888	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2023		371'534'987	392'624'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2023		34'734'296	30'574'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		125'599'856	18'313'662'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2023		251'050'544	255'107'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2023		23'849'558	179'083'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2023		11'570'901	18'162'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2023		15'396'544	22'019'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2023		1'519'070	15'924'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.01.2023		2'721'762	20'561'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2023		1'901'873	21'108'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.01.2023		1'560'709	2'642'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2023		6'456'728	131'890'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2023		3'143'105	15'097'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2023		3'466'505	5'013'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.01.2023		2'762'232	10'002'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 05.01.2023		69'779	336'000	CHF/PLN		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2023		14'879'292	15'913'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2023		806'038	1'264'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.01.2023		144'374	2'972'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		3'387'068	490'306'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.01.2023		50'027	521'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2023		1'250'000	165'319	DKK/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2023		2'213'021	1'927'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 05.01.2023		3'282'915	24'712'000	CHF/CNY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2023		473'034	679'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2023		7'906'870	8'042'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2023		3'659'000	331'304	SEK/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	NZD/CHF Verfall 05.01.2023		117'517	197'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.01.2023		55'471	201'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2023		165'998	169'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2023		793'000	734'154		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2023		28'876'000	197'786		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2023		1'520'000	1'412'688		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2023		1'085'000	1'069'966		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2023		114'570'000	806'235		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2023		335'000	208'062		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2023		587'000	399'518		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.01.2023		262'233'000	258'378'699		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.01.2023		406'224'000	375'359'100		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.01.2023		32'501'000	36'208'714		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 05.01.2023		17'449'000	1'544'743		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.01.2023		5'013'000	3'448'182		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.01.2023		16'445'000	1'538'709		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 05.01.2023		134'862'000	6'391'690		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.01.2023		22'111'000	15'085'296		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 05.01.2023		15'433'000	3'242'149		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.01.2023		10'203'000	2'681'961		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.01.2023		19'091'000	11'980'729		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 05.01.2023		19'311'000	2'559'171		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 05.01.2023		203'795'000	27'040'132		CNY/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.02.2023		246'949'869	250'898'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.02.2023		371'840'848	403'672'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.02.2023		34'366'128	30'919'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.02.2023		1'483'744	16'785'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.02.2023		3'518'140	5'129'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.02.2023		129'176'397	18'406'991'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.02.2023		1'560'473	16'711'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.02.2023		6'326'036	134'624'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.02.2023		1'645'763	2'818'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.02.2023		14'780'153	21'729'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.02.2023		3'268'054	15'648'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.02.2023		11'614'311	18'544'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.02.2023		2'425'705	18'322'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.02.2023		27'157'530	204'913'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.02.2023		4'862'650	4'915'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.02.2023		727'819	1'061'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.02.2023		34'907	393'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.02.2023		1'670'172	1'486'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.02.2023		5'702'000	273'230		MXN/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.02.2023		20'609	221'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.02.2023		5'161'275	5'517'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.02.2023		44'458	76'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.02.2023		3'174'326	23'438'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.02.2023		38'299	55'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.02.2023		37'256	280'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.02.2023		59'703'000	428'766		JPY/CHF	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.02.2023		55'819	265'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.02.2023		3'680'000	499'836		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.02.2023		572'000	392'063		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.02.2023		792'000	886'523		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.02.2023		9'964'000	9'175'170		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.02.2023		418'109'000	2'921'399		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.02.2023		5'622'000	5'563'222		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.02.2023		23'818'356	23'808'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.02.2023		145'978	1'635'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.02.2023		1'649'552	2'393'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.02.2023		154'219	1'658'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.02.2023		167'399	281'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.02.2023		561'261	11'486'000		CHF/MXN	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.02.2023		35'652'722	38'684'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.02.2023		297'049	1'400'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.02.2023		322'679	460'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.02.2023		223'157	1'659'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.02.2023		3'472'907	3'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.02.2023		12'578'301	1'779'479'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.02.2023		29'650'592	32'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.02.2023		137'993	1'026'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.02.2023		104'823	1'174'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 03.02.2023		538'752	10'979'000		CHF/MXN	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CAD/CHF Verfall 03.02.2023		932'998	1'348'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.02.2023		229'781	327'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 03.02.2023		300'532	1'414'000		CHF/PLN	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.02.2023		18'553'789	18'546'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.02.2023		82'546	885'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.02.2023		113'484	190'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.02.2023		2'316'912	3'540'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.02.2023		4'154'468	584'988'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.02.2023		3'830'234	3'359'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.02.2023		8'802'815	64'349'000		CHF/CNY	0.00	0.00	
	CHF/CNY Verfall 03.02.2023		289'020'000	39'302'963		CNY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/PLN Verfall 03.02.2023		18'727'000	3'963'158		PLN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.02.2023		470'039'000	431'769'365		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.02.2023		292'545'000	291'869'221		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 03.02.2023		151'387'000	7'395'982		MXN/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.02.2023		19'987'000	1'753'599		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.02.2023		5'971'000	4'173'221		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.02.2023		20'293'646'000	143'387'394		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.02.2023		25'959'000	17'870'565		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.02.2023		38'022'000	42'997'863		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.02.2023		19'475'000	1'791'038		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.02.2023		21'287'000	2'854'970		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.02.2023		3'365'000	1'997'585		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.02.2023		22'084'000	14'295'238		AUD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.02.2023		2'618'434	9'988'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.02.2023		186'591	692'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 06.02.2023		254'494	948'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 06.02.2023		11'628'000	3'090'490		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CNY/CHF Verfall 03.03.2023		38'170'638	281'115'000		CHF/CNY	273'830.07	0.03	b)
	PLN/CHF Verfall 03.03.2023		4'118'216	19'561'000		CHF/PLN	-11'937.06	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		432'041'471	471'781'000		CHF/USD	-9'998'859.18	-0.99	b)
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		293'010'990	294'054'000		CHF/EUR	774'371.72	0.08	b)
	MXN/CHF Verfall 03.03.2023		7'490'678	154'607'000		CHF/MXN	-410'117.57	-0.04	b)
	SEK/CHF Verfall 03.03.2023		1'783'860	20'363'000		CHF/SEK	-45'900.73	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 03.03.2023		4'167'491	5'978'000		CHF/SGD	6'279.17	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.03.2023		140'051'144	19'807'309'000		CHF/JPY	3'753'370.73	0.37	b)
	CAD/CHF Verfall 03.03.2023		18'261'337	26'603'000		CHF/CAD	-47'324.89	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.03.2023		42'970'662	38'090'000		CHF/GBP	-238'115.97	-0.02	b)
	NOK/CHF Verfall 03.03.2023		1'807'962	19'695'000		CHF/NOK	24'177.64	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 03.03.2023		2'924'297	21'828'000		CHF/DKK	9'522.67	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 03.03.2023		2'048'306	3'460'000		CHF/NZD	39'769.80	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.03.2023		14'767'479	22'858'000		CHF/AUD	323'299.43	0.03	b)
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		610'668	670'000		CHF/USD	-17'095.44	0.00	b)
	CHF/NZD Verfall 03.03.2023		11'000	6'461		NZD/CHF	-75.22	0.00	b)
	MXN/CHF Verfall 03.03.2023		16'440	340'000		CHF/MXN	-934.95	0.00	b)
	CHF/SGD Verfall 03.03.2023		35'000	24'332		SGD/CHF	31.07	0.00	b)
	CHF/PLN Verfall 03.03.2023		115'000	24'258		PLN/CHF	23.49	0.00	b)
	CHF/EUR Verfall 03.03.2023		1'027'000	1'024'337		EUR/CHF	-3'684.23	0.00	b)
	CHF/DKK Verfall 03.03.2023		75'000	10'056		DKK/CHF	-41.42	0.00	b)
	CHF/GBP Verfall 03.03.2023		36'000	40'474		GBP/CHF	363.82	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.03.2023		5'165	8'000		CHF/AUD	109.53	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 03.03.2023		44'000	30'111		CAD/CHF	170.97	0.00	b)
	CHF/JPY Verfall 03.03.2023		56'327'000	398'764		JPY/CHF	-11'167.60	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		2'963'431	3'266'000		CHF/USD	-96'681.16	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		2'088'585	2'101'000		CHF/EUR	570.60	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.03.2023		1'496'628	212'556'000		CHF/JPY	33'991.13	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.03.2023		400'002	359'000		CHF/GBP	-7'242.28	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 03.03.2023		199'297	1'473'000		CHF/CNY	723.42	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		2'017'114	2'187'000		CHF/USD	-32'020.48	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		1'398'809	1'419'000		CHF/EUR	-11'419.94	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.03.2023		1'433'504	208'540'000		CHF/JPY	-1'495.88	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 03.03.2023		205'502	183'000		CHF/GBP	-2'091.15	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		1'421'631	1'537'000		CHF/USD	-18'478.50	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 03.03.2023		397'487	2'956'000		CHF/CNY	-1'007.49	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.03.2023		1'108'224	1'121'000		CHF/EUR	-5'847.20	0.00	b)
	CHF/SGD Verfall 03.03.2023		5'943'000	4'129'618		SGD/CHF	7'229.51	0.00	b)
	CHF/USD Verfall 03.03.2023		478'650'000	448'935'408		USD/CHF	-458'409.91	-0.05	b)
	CHF/JPY Verfall 03.03.2023		20'162'000'000	138'228'656		JPY/CHF	509'532.50	0.05	b)
	CHF/MXN Verfall 03.03.2023		154'947'000	7'904'528		MXN/CHF	13'668.02	0.00	b)
	CHF/NOK Verfall 03.03.2023		19'695'000	1'786'455		NOK/CHF	-2'672.08	0.00	b)
	CHF/AUD Verfall 03.03.2023		22'866'000	14'395'908		AUD/CHF	53'303.33	0.01	b)
	CHF/CNY Verfall 03.03.2023		285'544'000	38'477'054		CNY/CHF	16'803.64	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 03.03.2023		297'668'000	296'272'830		EUR/CHF	-444'569.32	-0.04	b)
	CHF/GBP Verfall 03.03.2023		38'596'000	43'651'188		GBP/CHF	131'596.43	0.01	b)
	CHF/DKK Verfall 03.03.2023		21'753'000	2'908'963		DKK/CHF	-4'204.31	0.00	b)
	CHF/CAD Verfall 03.03.2023		26'559'000	18'324'462		CAD/CHF	-46'075.69	0.00	b)
	CHF/SEK Verfall 03.03.2023		20'363'000	1'834'625		SEK/CHF	-4'860.96	0.00	b)
	CHF/PLN Verfall 03.03.2023		19'446'000	4'100'092		PLN/CHF	5'780.68	0.00	b)
	CHF/NZD Verfall 03.03.2023		3'449'000	1'986'586		NZD/CHF	15'561.22	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 06.03.2023		3'106'014	11'714'000		CHF/ILS	102'222.98	0.01	b)
	ILS/CHF Verfall 06.03.2023		21'130	80'000		CHF/ILS	615.66	0.00	b)
	CHF/ILS Verfall 06.03.2023		11'794'000	3'005'748		ILS/CHF	18'541.10	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 05.04.2023		3'796'621	5'480'000		CHF/SGD	-7'089.95	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 05.04.2023		433'323'441	463'695'000		CHF/USD	360'776.74	0.04	b)
	JPY/CHF Verfall 05.04.2023		139'740'250	20'362'789'000		CHF/JPY	-533'201.81	-0.05	b)
	MXN/CHF Verfall 05.04.2023		7'699'055	152'436'000		CHF/MXN	-19'710.41	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 05.04.2023		1'788'672	19'758'000		CHF/NOK	2'358.97	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 05.04.2023		14'117'504	22'482'000		CHF/AUD	-57'148.90	-0.01	b)
	EUR/CHF Verfall 05.04.2023		290'686'694	292'547'000		CHF/EUR	404'380.60	0.04	b)
	ILS/CHF Verfall 05.04.2023		2'931'505	11'534'000		CHF/ILS	-18'095.47	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 05.04.2023		42'164'209	37'395'000		CHF/GBP	-132'402.12	-0.01	b)
	DKK/CHF Verfall 05.04.2023		2'836'839	21'244'000		CHF/DKK	3'543.70	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 05.04.2023		17'802'767	25'890'000		CHF/CAD	40'612.90	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 05.04.2023		1'842'910	20'495'000		CHF/SEK	4'394.95	0.00	b)
	PLN/CHF Verfall 05.04.2023		3'988'879	19'033'000		CHF/PLN	-6'138.24	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 05.04.2023		1'941'517	3'383'000		CHF/NZD	-15'692.68	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 06.04.2023		38'446'052	285'823'000		CHF/CNY	-41'628.06	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-5'821'910.06</b>	<b>-0.58</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'986'447.54	0.59
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	574'051'207.69	56.77
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	433'778'508.31	42.90
Derivative Finanzinstrumente	-5'821'910.06	-0.58
Sonstige Vermögenswerte	3'136'706.40	0.31
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'011'130'959.88</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-23'709.49	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'011'107'250.39</b>	

## Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'007'829'716.00	99.67
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-5'821'910.06	-0.58
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## Ausgeliehene Effekten

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>188'060'761.85</b>	<b>18.60</b>
US912810QE10 4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	400 USD 107.56%	403'251.81 0.04
US912810QS06 3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	681 USD 95.88%	611'938.73 0.06
US912810QZ49 3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	872 USD 86.13%	703'884.12 0.07
US912810RP57 3.0000 % T 3 11/15/45	450 USD 83.34%	351'512.69 0.03
US912810RY64 2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	1'326 USD 79.50%	988'020.83 0.10
US912810RZ30 2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	1'120 USD 79.53%	834'855.44 0.08
US912810SD19 3.0000 % T 3 08/15/48	1'750 USD 83.45%	1'368'787.64 0.14
US912810SN90 1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	2'380 USD 55.48%	1'237'665.09 0.12
US912810SP49 1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	2'700 USD 57.34%	1'451'126.60 0.14
US912810SQ22 1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	1'940 USD 62.92%	1'144'086.52 0.11
US912810SR05 1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	1'790 USD 63.27%	1'061'393.07 0.10
US912810SS87 1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	2'000 USD 61.28%	1'148'717.03 0.11
US912810SU34 1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	2'950 USD 65.31%	1'805'817.15 0.18

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	2'500 USD	75.94%	1'779'310.55	0.18	
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	3'200 USD	67.23%	2'016'493.52	0.20	
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	3'306 USD	69.25%	2'145'744.84	0.21	
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	2'850 USD	65.06%	1'737'925.10	0.17	
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	2'950 USD	71.33%	1'972'142.27	0.20	
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	2'685 USD	81.91%	2'061'184.09	0.20	
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	389 USD	101.75%	370'970.58	0.04	
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	2'610 USD	90.75%	2'219'946.92	0.22	
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	1'970 USD	95.41%	1'761'564.31	0.17	
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	2'110 USD	95.77%	1'893'858.51	0.19	
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	2'700 USD	93.88%	2'375'577.28	0.23	
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	2'600 USD	93.69%	2'283'023.84	0.23	
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	2'250 USD	94.77%	1'998'429.24	0.20	
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	2'000 USD	97.64%	1'830'273.42	0.18	
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	2'570 USD	92.05%	2'217'163.12	0.22	
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	1'200 USD	93.72%	1'054'054.78	0.10	
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	2'250 USD	96.75%	2'040'276.09	0.20	
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	1'660 USD	90.47%	1'407'544.48	0.14	
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	1'950 USD	95.70%	1'749'106.11	0.17	
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	2'417 USD	97.75%	2'214'363.25	0.22	
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	3'467 USD	95.64%	3'107'790.07	0.31	
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	2'582 USD	94.77%	2'293'308.58	0.23	
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	1'000 USD	93.94%	880'429.22	0.09	
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	2'490 USD	94.16%	2'197'373.84	0.22	
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	2'740 USD	92.09%	2'365'027.36	0.23	
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	3'630 USD	91.59%	3'116'218.60	0.31	
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	1'660 USD	91.94%	1'430'395.80	0.14	
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	2'130 USD	92.52%	1'846'928.64	0.18	
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	3'165 USD	96.80%	2'871'379.02	0.28	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	3'834 USD	96.92%	3'482'806.83	0.34	
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	1'740 USD	92.66%	1'511'052.02	0.15	
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	1'940 USD	96.22%	1'749'511.85	0.17	
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	900 USD	96.00%	809'784.00	0.08	
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	2'100 USD	86.42%	1'700'977.05	0.17	
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	2'000 USD	94.52%	1'771'695.30	0.18	
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	1'600 USD	94.70%	1'420'167.99	0.14	
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	1'450 USD	87.00%	1'182'340.88	0.12	
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	700 USD	90.69%	594'978.02	0.06	
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	1'500 USD	94.31%	1'325'915.86	0.13	
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	3'100 USD	89.86%	2'610'841.82	0.26	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	2'080 USD	91.09%	1'775'854.44	0.18	
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	1'900 USD	85.73%	1'526'736.41	0.15	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	3'440 USD	79.06%	2'549'085.69	0.25	
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	1'850 USD	90.58%	1'570'545.34	0.16	
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	2'050 USD	90.08%	1'730'727.22	0.17	
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	3'700 USD	78.63%	2'726'577.41	0.27	
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	2'040 USD	89.81%	1'717'206.02	0.17	
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	2'000 USD	84.08%	1'576'044.36	0.16	
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	2'000 USD	89.64%	1'680'313.42	0.17	
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	4'450 USD	79.91%	3'332'699.91	0.33	
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	2'100 USD	84.72%	1'667'455.62	0.16	
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	2'500 USD	89.33%	2'093'069.51	0.21	
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	1'800 USD	96.19%	1'622'731.22	0.16	
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	3'048 USD	88.83%	2'537'586.66	0.25	
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	2'745 USD	84.86%	2'183'220.76	0.22	
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	4'320 USD	81.36%	3'294'176.21	0.33	
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	2'600 USD	95.30%	2'322'242.02	0.23	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	3'120 USD	86.31%	2'523'967.39	0.25	
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	3'188 USD	88.89%	2'656'009.95	0.26	
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	2'250 USD	95.08%	2'005'019.28	0.20	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Währ- ung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	2'888	USD	89.47%	2'421'720.44	0.24	
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	4'190	USD	84.06%	3'301'199.52	0.33	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	2'930	USD	86.36%	2'371'551.63	0.23	
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	2'000	USD	93.95%	1'761'151.23	0.17	
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	2'000	USD	89.13%	1'670'648.13	0.17	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	2'000	USD	88.09%	1'651'317.34	0.16	
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	2'000	USD	84.81%	1'589'810.31	0.16	
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	2'500	USD	81.06%	1'899'395.70	0.19	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	2'580	USD	85.23%	2'061'056.80	0.20	
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	550	USD	93.17%	480'289.39	0.05	
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	2'000	USD	85.64%	1'605'333.42	0.16	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	2'700	USD	86.09%	2'178'666.91	0.22	
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	1'100	USD	93.17%	960'578.79	0.10	
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	4'460	USD	81.39%	3'402'237.79	0.34	
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	2'591	USD	89.31%	2'168'877.93	0.21	
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	2'200	USD	86.59%	1'785'519.83	0.18	
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	1'982	USD	93.33%	1'733'690.69	0.17	
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	2'000	USD	85.91%	1'610'312.66	0.16	
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	4'212	USD	84.72%	3'344'439.55	0.33	
US91282CEC10	1.8750 % T 1 7/8 02/28/27	2'200	USD	91.06%	1'877'663.22	0.19	
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	2'000	USD	90.63%	1'698'765.63	0.17	
US91282CEH07	2.6250 % T 2 5/8 04/15/25	2'000	USD	95.69%	1'793'662.19	0.18	
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	4'244	USD	91.98%	3'658'852.57	0.36	
US91282CEU18	2.8750 % T 2 7/8 06/15/25	1'000	USD	96.09%	900'638.67	0.09	
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	2'200	USD	90.88%	1'873'797.06	0.19	
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	2'200	USD	101.61%	2'095'134.61	0.21	
US91282CFZ95	3.8750 % T 3 7/8 11/30/27	1'800	USD	98.58%	1'663'062.17	0.16	
US91282CGC91	3.8750 % T 3 7/8 12/31/27	2'050	USD	98.55%	1'893'442.80	0.19	
US91282CGD74	4.2500 % T 4 1/4 12/31/24	1'000	USD	98.88%	926'705.94	0.09	
US91282CGG06	4.1250 % T 4 1/8 01/31/25	88	USD	98.70%	81'038.32	0.01	

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.63203454
CAD	1 = CHF	0.68842043
CNY	1 = CHF	0.13482314
DKK	100 = CHF	13.35494400
EUR	1 = CHF	0.99395514
GBP	1 = CHF	1.13468171
ILS	1 = CHF	0.25656994
JPY	100 = CHF	0.68806700
MXN	1 = CHF	0.05114598
NOK	100 = CHF	9.05857500
NZD	1 = CHF	0.58067324
PLN	1 = CHF	0.21123031
SEK	100 = CHF	8.98730400
SGD	1 = CHF	0.69624485
USD	1 = CHF	0.93725000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	23'228'907.70	11.431
Bond	CHF	178'984'484.95	88.082
Equity	CHF	988'227.62	0.486
Total	CHF	203'201'620.27	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	1'027'502'239.57	101.621
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	2'033'823'712.18	201.148

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

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

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	-	0.080	0.00 - 0.01	-	0.003
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.080	0.00 - 0.01	-	0.003
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.080	0.00 - 0.01	-	0.003
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.080	0.00 - 0.01	-	0.003

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	188'060'761.85
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:** 01.03.2022 - 28.02.2023

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

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 TR

## 10 TER

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

## 11 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FAH1 CHF	Nein	CHF	1.40000	0.49000	0.91000

## 12 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DTH1 CHF	Nein	CHF	1.695	0.593	1.102
GTH1 CHF	Nein	CHF	1.526	0.534	0.992
NTH1 CHF	Nein	CHF	1.929	0.675	1.254

## 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:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

## 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 Anleger**

des

**Swisscanto (CH) Index Fund V**

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

(im Folgenden "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 USA**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan**  
**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 hedged CHF**  
**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 hedged CHF**

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA in Bezug auf die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF wie folgt zu ändern:

### **Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF**

<b>Aktuelle Bezeichnung</b>	<b>Neue Bezeichnung</b>
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF (neu: Swisscanto (CH) Index Commodity Fund) wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst und der erste Satz in § 8 Ziff. 32 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds lautet neu entsprechend wie folgt: "Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex Bloomberg Commodity Index nach."

\*\*\*

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 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 Fondsvertrages erstreckt.

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass gegen die vorliegend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages keine Einwendungen erhoben werden können, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 15. Juni 2022

#### **Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### **Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich





**Mitteilung an die Anleger**

des

**Swisscanto (CH) Index Fund V**

ein 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 USA**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan**

**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 hedged CHF**

(neu: 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, 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.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF wird umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Sodann werden bestehende Anteilsklassen umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Ausserdem sollen die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen neu einem Soft Closing unterzogen werden können (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Weiter wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen und beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. eine Präzisierung bei der bestehenden Gating-Bestimmung vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 6 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

**1. Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF**

<b>Aktuelle Bezeichnung</b>	<b>Neue Bezeichnung</b>
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF (neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked) wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst und der erste Satz in § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds

lautet neu entsprechend wie folgt: "Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-JPY World Inflation-Linked Securities Index nach."

## 2. Umbenennung von Anteilsklassen

Die bestehenden Anteilsklassen mit Währungsabsicherung der Teilvermögen werden wie folgt umbenannt (vgl. § 6 Ziff. 4 und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages):

<b>Bisherige Anteilsklassenbezeichnung</b>	<b>Neue Anteilsklassenbezeichnung</b>
FTH CHF	FTH1 CHF
FTH EUR	FTH1 EUR
FTH GBP	FTH1 GBP
FTH USD	FTH1 USD
FAH CHF	FAH1 CHF
FAH EUR	FAH1 EUR
FAH GBP	FAH1 GBP
FAH USD	FAH1 USD
CTH CHF	CTH1 CHF
CTH EUR	CTH1 EUR
CTH GBP	CTH1 GBP
CTH USD	CTH1 USD
CAH CHF	CAH1 CHF
CAH EUR	CAH1 EUR
CAH GBP	CAH1 GBP
CAH USD	CAH1 USD
DTH CHF	DTH1 CHF
DTH EUR	DTH1 EUR
DTH GBP	DTH1 GBP
DTH USD	DTH1 USD
DAH CHF	DAH1 CHF
DAH EUR	DAH1 EUR
DAH GBP	DAH1 GBP

DAH USD	DAH1 USD
GTH CHF	GTH1 CHF
GTH EUR	GTH1 EUR
GTH GBP	GTH1 GBP
GTH USD	GTH1 USD
GAH CHF	GAH1 CHF
GAH EUR	GAH1 EUR
GAH GBP	GAH1 GBP
GAH USD	GAH1 USD
MTH CHF	MTH1 CHF
MTH EUR	MTH1 EUR
MTH GBP	MTH1 GBP
MTH USD	MTH1 USD
MAH CHF	MAH1 CHF
MAH EUR	MAH1 EUR
MAH GBP	MAH1 GBP
MAH USD	MAH1 USD
NTH CHF	NTH1 CHF
NTH EUR	NTH1 EUR
NTH GBP	NTH1 GBP
NTH USD	NTH1 USD
NAH CHF	NAH1 CHF
NAH EUR	NAH1 EUR
NAH GBP	NAH1 GBP
NAH USD	NAH1 USD
STH CHF	STH1 CHF
STH EUR	STH1 EUR
STH GBP	STH1 GBP

STH USD	STH1 USD
SAH CHF	SAH1 CHF
SAH EUR	SAH1 EUR
SAH GBP	SAH1 GBP
SAH USD	SAH1 USD

### 3. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Fondsleitung darf keine Beteiligungsrechte erwerben, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben. Vorbehalten bleiben die durch die Aufsichtsbehörde gewährten Ausnahmen."

### 4. Soft Closing

Für die Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect**, **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect** und **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect** wird eine neue Bestimmung betreffend Soft Closing aufgenommen (vgl. neue Ziff. 8 in § 5 des Fondsvertrages).

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen können einem "Soft Closing" unterzogen werden, wonach Anleger keine Anteile zeichnen können, wenn die Schließung nach Auffassung der Fondsleitung notwendig ist, um die Interessen der bestehenden Anleger zu schützen. Das Soft Closing gilt in Bezug auf die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder Anteilsklassen dieser Teilvermögen für neue Zeichnungen oder Wechsel in das jeweilige Teilvermögen oder die jeweilige Anteilsklasse, jedoch nicht für Rücknahmen, Übertragungen oder Wechsel aus dem jeweiligen Teilvermögen oder der jeweiligen Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens heraus. Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect, Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect oder eine Anteilsklasse dieser Teilvermögen können ohne Benachrichtigung der Anleger einem Soft Closing unterzogen werden.

### 5. Gating

Für das Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect** wird eine neue Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (vgl. neue Ziff. 10 in § 17 des Fondsvertrages).

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect behält sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. Gleichsam behält sich die Fondsleitung beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang)

an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. 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. Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge stattfindet.

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.

Beim Teilvermögen **Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.** besteht bereits eine Bestimmung betreffend Gating, welche neu leicht präzisiert wird (vgl. bestehende Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages).

Beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. behält sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto 15% des Fondsvermögens übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahmeanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. 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.

## **6. Keine Regelung der Umwandlung mehr**

Bisher wurde in § 25 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 25 des Fondsvertrages und in § 25 Ziff. 9 des Fondsvertrages).

\*\*\*

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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 – 5 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags erstreckt.

Die 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.

Kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 3 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 29. Juni 2022

**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"  
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

Zurzeit 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, 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.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible soll repositioniert werden und neu unter anderem als Dachfonds ausgerichtet werden, was insbesondere mit Änderungen der Anlagepolitik, Risikoverteilung und mit Anpassungen bei der Bestimmung betreffend die Laufzeit der Teilvermögen und Auflösung verbunden ist (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem sollen 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 künftig als Zielfonds von anderen kollektiven Kapitalanlagen der Swisscanto Fondsleitung AG dienen. Die diesbezüglichen Anpassungen des Fondsvertrages werden unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung aufgeführt.

Schliesslich soll das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible umbenannt werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

## **1 Repositionierung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible**

In § 8 Ziff. 15 des Fondsvertrages ist geregelt, dass das Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex MSCI World ex Switzerland Index nachbildet. Neu wird diese Bestimmung ergänzt, in dem ausgeführt wird, dass dies mittels indirekten und direkten Anlagen erfolgen kann. In diesem Zusammenhang wird in § 18 Ziff. 15 lit. b des angepassten Fondsvertrages eine Limite aufgenommen, wonach die Fondsleitung höchstens 30% des Vermögens des Teilvermögens direkt investieren darf. Betreffend diese Investitionen geltend die Bestimmungen gemäss lit. ba – bd des angepassten Fondsvertrages.

Zudem wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen in die Swisscanto-Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible investieren kann (vgl. die Anpassungen in lit. a von § 8 Ziff. 15 des angepassten Fondsvertrags). Ebenfalls wird unter der gleichen Bestimmung neu normiert, dass Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Ebenfalls wird in lit. b von § 8 Ziff. 15 des angepassten Fondsvertrags die Bestimmung gestrichen, wonach die Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen.

Das Teilvermögen soll zudem neu als Dachfonds ausgestaltet werden, welches in diverse Swisscanto-Zielfonds investieren kann (betreffend Zielfonds siehe dazu auch die Ausführungen unter nachstehender Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Einhergehend mit der Repositionierung zum Dachfonds wird in Ziff. 13 von § 15 des Fondsvertrages auch für das Teilvermögen insbesondere eine entsprechende Ergänzung aufgenommen, wonach die in Ziff. 13 erwähnte Grenze von 25% der Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen auf 100% angehoben ist für die Investitionen in die Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

Zudem findet künftig für das Teilvermögen die Regelung in § 15 Ziff. 10 des Fondsvertrages, dass Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss den vorstehenden Ziff. 3 bis 9 desselben Emittenten bzw. Schuldners 20% des Vermögens nicht übersteigen dürfen, keine Anwendung mehr.

Abschliessend wird in Ziff. 12 von § 15 des Fondsvertrages für das Teilvermögen präzisiert, dass sich der Anteil der Anlagen in einen Swisscanto-Zielfonds am Vermögen des Teilvermögens nach der Gewichtung des jeweiligen Referenzindex des Swisscanto-Zielfonds im Referenzindex des Teilvermögens bestimmt. Zudem ist diese Gewichtung in Ziff. 5.3 des Prospektes ausgewiesen (für den dort genannten Zeitpunkt).

Zusätzlich erfolgt der Hinweis, dass im Rahmen der Nachbildung des Referenzindex überdies die Gewichtung eines Swisscanto-Zielfonds (aufgrund der Berücksichtigung der Direktanlagenquote von höchstens 20% bzw. 30%) bis zu 15 Prozentpunkte von der Gewichtung des jeweiligen Referenzindex des Swisscanto-Zielfonds im Referenzindex des Teilvermögens abweichen kann.

In Zusammenhang mit der Ausgestaltung zum Dachfonds werden in § 1 Ziff. 5, § 8 Ziff. 7, 9 und Ziff. 11, § 15 Ziff. 10, Ziff. 12, 13 und Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages diverse Anpassungen vorgenommen.

## **2 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 Zielfonds**

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 sollen neu als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlagen (Dachfonds) dienen:

- Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible soll zudem ergänzend als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds) dienen:

- Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (im Umbrella-Fonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I) mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 7, 9 und Ziff. 11, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible zudem neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen dieses Teilvermögen bis zu 100% der Anteile der Zielfonds Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible erwerben darf (vgl. in diesem Zusammenhang auch die entsprechenden Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung betreffend die Repositionierung zum Dachfonds beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible).

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds), für welche 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 Zielfonds fungieren, soll (wie bereits erwähnt) gemäss der Risikoverteilungsvorschrift jeweils bis zu 100% der Anteile des jeweiligen Zielfonds erwerben können (vgl. dazu für das Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des jeweiligen Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden 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 jeweiligen Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Entsprechende Hinweise bzw. Ergänzungen werden in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

### 3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible

Die Bezeichnung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible soll wie folgt geändert werden:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible	Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible

Die Bezeichnung des Teilvermögens wird im gesamten Fondsvertrag des Umbrella-Fonds entsprechend angepasst.

\*\*\*

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, der Jahres- und Halbjahresbericht, das Basisinformationsblatt sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 16. Januar 2023

#### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich