

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

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art  
"übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

### Halbjahresbericht per 31. März 2021

---

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung .....	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I.....	28
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung.....	28
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte .....	28
Pauschale Verwaltungskommission .....	29
Benchmark.....	29
TER.....	29
Erklärung der Fussnoten .....	29
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte .....	30

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

**Swisscanto Fondsleitung AG**

Zürich, 24.05.2021

## 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

Regina Kleeb, Mitglied  
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement  
Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank

### Geschäftsleitung

Hans Frey  
Geschäftsführer

Andreas Hogg  
stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer  
Leiterin Administration & Operations

### Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## Vertriebsorganisation

---

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

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

Übersicht	von	01.10.2020	01.10.2019	01.10.2018	01.10.2017
	bis	31.03.2021	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2018
<b>Konsolidiert</b>		<b>USD</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		210'075'934.99	171'259'864.32	153'464'614.76	193'244'287.36
<b>Klasse DA USD</b>		<b>USD</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		30'260'874.17	29'617'099.33	29'836'009.55	29'868'849.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		342'940.349	319'589.566	336'240.432	355'395.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		88.2395	92.6723	88.7300	84.0400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	-	84.0400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		83.0466	85.1427	-	-
Ausschüttung je Anteil		-	1.60	1.80	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.23 %
<b>Klasse FA USD</b>		<b>USD</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		297'024.26	346'767.63	366'650.53	443'951.04
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'362.440	3'745.442	4'135.000	5'283.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		88.3359	92.5839	88.6700	84.0300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	-	84.0300
Ausschüttung je Anteil		-	1.40	1.80	1.80
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.24 %	0.36 %
<b>Klasse GT USD</b>		<b>USD</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'643'939.10	24'036'948.16	36'181'623.72	33'881'882.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		224'872.106	220'168.634	350'977.979	351'310.682
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		105.1439	109.1752	103.0900	96.4400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	-	96.4400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		98.9562	100.3047	-	-
Thesaurierung je Anteil		-	1.88	2.07	2.60
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.15 %
<b>Klasse NT USD</b>		<b>USD</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		130'971'370.09	92'225'504.85	87'080'330.96	129'049'604.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'283'389.245	870'556.627	871'338.627	1'383'438.230
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		102.0512	105.9385	99.9400	93.2800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		-	-	-	93.2800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		96.0455	97.3310	-	-
Thesaurierung je Anteil		-	1.96	2.14	2.27
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse NTH CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		24'902'727.37	25'033'544.35		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		241'615.084	227'591.107		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		97.0022	101.0565		
Thesaurierung je Anteil (in USD)		-	2.01		
Total Expense Ratio (TER)		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	YTD / 31.03.2021	2020	2019	2018
Klasse DA USD	-5.71 %	9.95 %	5.63 %	-1.05 %
Klasse FA USD	-5.71 %	9.93 %	5.57 %	-1.15 %
Klasse GT USD	-5.70 %	10.00 %	5.68 %	-0.97 %
Klasse NT USD	-5.67 %	10.16 %	5.81 %	-0.83 %
Klasse NTH CHF (Lancierung 28.02.2020)	-3.37 %	1.02 %	-	-
Klasse PV (Schliessung 22.06.2018)	-	-	-	-1.21 %
Benchmark	-5.68 %	10.11 %	5.89 %	-0.85 %
Tracking Error *	-	0.05 %	0.07 %	0.04 %

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 Error: Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.

Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) \* QUADRATWURZEL(12)

### Vermögensrechnung

#### (Verkehrswerte)

	31.03.2021	30.09.2020
Bankguthaben auf Sicht	1'115'857.82	932'952.14
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	232'615'161.71	169'335'519.29
Derivative Finanzinstrumente	0.00	-1'909.23
Sonstige Vermögenswerte	1'260'427.87	1'000'512.03
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>234'991'447.40</b>	<b>171'267'074.23</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-24'907'525.30	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-7'987.11	-7'209.91
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>210'075'934.99</b>	<b>171'259'864.32</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DA USD	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	31.03.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			319'589.566	336'240.432
Ausgegebene Anteile			27'158.783	20'746.025
Zurückgenommene Anteile			-3'808.000	-37'396.891
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>342'940.349</b>	<b>319'589.566</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse FA USD	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	31.03.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			3'745.442	4'135.000
Ausgegebene Anteile			2'485.631	1'124.417
Zurückgenommene Anteile			-2'868.633	-1'513.975
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>3'362.440</b>	<b>3'745.442</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse GT USD	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	31.03.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			220'168.634	350'977.979
Ausgegebene Anteile			18'893.472	9'603.000
Zurückgenommene Anteile			-14'190.000	-140'412.345
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>224'872.106</b>	<b>220'168.634</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT USD	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	31.03.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			870'556.627	871'338.627
Ausgegebene Anteile			440'930.618	325'047.000
Zurückgenommene Anteile			-28'098.000	-325'829.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>1'283'389.245</b>	<b>870'556.627</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse NTH CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<i>Lancierung</i> <b>28.02.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>31.03.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			227'591.107	0.000
Ausgegebene Anteile			14'023.977	228'772.107
Zurückgenommene Anteile			0.000	-1'181.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>241'615.084</b>	<b>227'591.107</b>

<b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>31.03.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			171'259'864.32	153'464'614.76
Ausbezahlte Ausschüttung			-532'250.42	-606'319.98
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-1'130'156.63	-918'265.96
Saldo aus dem Anteilverkehr			48'119'602.40	8'400'841.41
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			-7'641'124.68	10'918'994.09
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>210'075'934.99</b>	<b>171'259'864.32</b>

<b>Erfolgsrechnung</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>31.03.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
<b>Ertrag</b>				
Erträge der Bankguthaben auf Sicht			0.00	1'434.30
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-2'279.86	-1'559.22
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			1'807'739.78	3'041'118.49
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			242'120.28	454'848.40
<b>Total Ertrag</b>			<b>2'047'580.20</b>	<b>3'495'841.97</b>
<b>Aufwand</b>				
Passivzinsen			-0.61	-231.63
Reglementarische Vergütungen			-44'374.25	-98'291.18
Sonstige Aufwendungen			-0.28	-77.18
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-34'574.79	-301'731.44
<b>Total Aufwand</b>			<b>-78'949.93</b>	<b>-400'331.43</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			<b>1'968'630.27</b>	<b>3'095'510.54</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-568'632.64	-1'376.07
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen			61'449.58	60'263.54
<b>Realisierter Erfolg</b>			<b>1'461'447.21</b>	<b>3'154'398.01</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-9'102'571.89	7'764'596.08
<b>Gesamterfolg</b>			<b>-7'641'124.68</b>	<b>10'918'994.09</b>

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>								<b>232'615'161.71</b>	<b>98.99</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>								<b>232'615'161.71</b>	<b>98.99</b>	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	130	0	0	130	EUR	142.56 %	217'807.49	0.09	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	140	0	0	140	EUR	162.41 %	267'223.36	0.11	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	150	0	0	150	EUR	127.09 %	224'052.42	0.10	a)
AT0000A0N9A0	3.6500 % RAGB 3.65 04/20/22	75	0	0	75	EUR	104.42 %	92'043.25	0.04	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	10	15	0	25	EUR	213.87 %	62'840.10	0.03	a)
AT0000A0U3T4	3.4000 % RAGB 3.4 11/22/22	140	0	0	140	EUR	106.59 %	175'384.61	0.07	a)
AT0000A105W3	1.7500 % RAGB 1 3/4 10/20/23	60	35	0	95	EUR	106.11 %	118'475.05	0.05	a)
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	0	65	0	65	EUR	130.32 %	99'556.91	0.04	a)
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	250	0	0	250	EUR	108.13 %	317'711.70	0.14	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	0	100	0	100	EUR	106.93 %	125'673.15	0.05	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	150	0	0	150	EUR	125.36 %	221'006.05	0.09	a)
AT0000A1PE50	0.0000 % RAGB 0 07/15/23	80	0	0	80	EUR	101.45 %	95'386.97	0.04	a)
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/86	20	0	0	20	EUR	135.79 %	31'918.67	0.01	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/17	42	10	0	52	EUR	173.17 %	105'833.46	0.05	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	60	0	0	60	EUR	107.79 %	76'011.05	0.03	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	80	0	0	80	EUR	106.06 %	99'721.45	0.04	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	0	70	0	70	EUR	101.43 %	83'447.14	0.04	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	0	30	0	30	EUR	105.91 %	37'342.66	0.02	a)
AT0000A2EJZ6	0.0000 % RAGB 0 04/20/23	0	50	0	50	EUR	101.30 %	59'528.71	0.03	a)
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/20	0	22	0	22	EUR	96.66 %	24'992.89	0.01	a)
AT0000A2NWB3	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	0	50	0	50	EUR	100.72 %	59'187.87	0.03	a)
<b>AT</b>								<b>2'595'144.96</b>	<b>1.10</b>	
AU0000013740	2.5000 % ACGB 2 1/2 05/21/30 155	245	45	0	290	AUD	107.19 %	236'753.04	0.10	a)
AU0000018442	2.7500 % ACGB 2 3/4 05/21/41 156	0	105	0	105	AUD	103.38 %	82'675.55	0.04	a)
AU0000047003	1.5000 % ACGB 1 1/2 06/21/31 157	170	113	0	283	AUD	97.14 %	209'380.15	0.09	a)
AU0000075681	1.2500 % ACGB 1 1/4 05/21/32 158	100	80	0	180	AUD	93.34 %	127'964.97	0.05	a)
AU0000083768	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/24 159	75	160	0	235	AUD	99.67 %	178'388.14	0.08	a)
AU0000087454	1.0000 % ACGB 1 12/21/30 160	180	181	0	361	AUD	93.33 %	256'621.61	0.11	a)
AU0000095457	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/25 161	0	210	0	210	AUD	98.08 %	156'880.33	0.07	a)
AU0000097495	1.7500 % ACGB 1 3/4 06/21/51 162	110	42	0	152	AUD	79.82 %	92'405.94	0.04	a)
AU0000101792	1.0000 % ACGB 1 11/21/31 163	170	65	0	235	AUD	91.70 %	164'128.19	0.07	a)
AU0000106411	0.5000 % ACGB 0 1/2 09/21/26 164	50	165	0	215	AUD	97.83 %	160'196.36	0.07	a)
AU000XCLWAG2	4.5000 % ACGB 4 1/2 04/21/33 140	100	50	0	150	AUD	127.52 %	145'683.84	0.06	a)
AU000XCLWAI8	4.2500 % ACGB 4 1/4 04/21/26 142	350	0	137	213	AUD	117.26 %	190'230.98	0.08	a)
AU000XCLWAM0	2.7500 % ACGB 2 3/4 06/21/35 145	50	63	0	113	AUD	107.23 %	92'287.33	0.04	a)
AU000XCLWAP3	3.2500 % ACGB 3 1/4 06/21/39 147	100	0	0	100	AUD	112.04 %	85'332.98	0.04	a)
AU000XCLWAQ1	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/27 148	210	50	100	160	AUD	110.06 %	134'124.74	0.06	a)
AU000XCLWAR9	2.2500 % ACGB 2 1/4 05/21/28 149	190	55	46	199	AUD	106.58 %	161'533.97	0.07	a)
AU000XCLWAS7	3.0000 % ACGB 3 03/21/47 150	100	44	0	144	AUD	106.08 %	116'348.19	0.05	a)
AU000XCLWAT5	2.0000 % ACGB 2 12/21/21 151	140	0	140	0	AUD	0.00 %	0.00	0.00	
AU000XCLWUA3	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/28 152	200	55	120	135	AUD	109.89 %	112'991.92	0.05	a)
AU000XCLWUA9	2.2500 % ACGB 2 1/4 11/21/22 153	180	58	0	238	AUD	103.51 %	187'637.18	0.08	a)
AU000XCLWAX7	2.7500 % ACGB 2 3/4 11/21/29 154	210	60	0	270	AUD	109.52 %	225'212.67	0.10	a)
AU3TB0000051	5.7500 % ACGB 5 3/4 07/15/22 128	160	41	0	201	AUD	107.23 %	164'166.30	0.07	a)
AU3TB0000101	5.5000 % ACGB 5 1/2 04/21/23 133	220	65	93	192	AUD	111.03 %	162'372.57	0.07	a)
AU3TB0000135	4.7500 % ACGB 4 3/4 04/21/27 136	240	0	0	240	AUD	121.95 %	222'917.89	0.09	a)
AU3TB0000143	2.7500 % ACGB 2 3/4 04/21/24 137	290	0	134	156	AUD	107.98 %	128'303.78	0.05	a)
AU3TB0000150	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/29 138	240	0	0	240	AUD	113.50 %	207'475.29	0.09	a)
AU3TB0000168	3.2500 % ACGB 3 1/4 04/21/25 139	240	50	68	222	AUD	110.95 %	187'602.94	0.08	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
AU3TB0000192	3.7500 % ACGB 3 3/4 04/21/37 144	100	0	0	100	AUD	119.72 %	91'183.21	0.04	a)
<b>AU</b>								<b>4'280'800.06</b>	<b>1.82</b>	
BE0000291972	5.5000 % BGB 5 1/2 03/28/28 31	380	0	0	380	EUR	141.57 %	632'259.97	0.27	a)
BE0000304130	5.0000 % BGB 5 03/28/35 44	150	43	0	193	EUR	166.09 %	376'733.91	0.16	a)
BE0000308172	4.0000 % BGB 4 03/28/22 48	140	0	140	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
BE0000320292	4.2500 % BGB 4 1/4 03/28/41 60	150	0	0	150	EUR	171.20 %	301'815.83	0.13	a)
BE0000325341	4.2500 % BGB 4 1/4 09/28/22 65	70	75	0	145	EUR	107.33 %	182'913.71	0.08	a)
BE0000328378	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/23 68	70	50	0	120	EUR	106.49 %	150'188.63	0.06	a)
BE0000331406	3.7500 % BGB 3 3/4 06/22/45 71	0	70	0	70	EUR	169.66 %	139'580.42	0.06	a)
BE0000332412	2.6000 % BGB 2.6 06/22/24 72	0	141	0	141	EUR	110.51 %	183'133.45	0.08	a)
BE0000333428	3.0000 % BGB 3 06/22/34 73	0	50	0	50	EUR	137.13 %	80'584.12	0.03	a)
BE0000334434	0.8000 % BGB 0.8 06/22/25 74	400	0	0	400	EUR	105.87 %	497'714.05	0.21	a)
BE0000335449	1.0000 % BGB 1 06/22/31 75	110	70	0	180	EUR	110.73 %	234'252.81	0.10	a)
BE0000336454	1.9000 % BGB 1.9 06/22/38 76	0	60	0	60	EUR	124.95 %	88'111.89	0.04	a)
BE0000337460	1.0000 % BGB 1 06/22/26 77	50	50	0	100	EUR	107.89 %	126'802.61	0.05	a)
BE0000338476	1.6000 % BGB 1.6 06/22/47 78	150	0	0	150	EUR	120.90 %	213'139.80	0.09	a)
BE0000339482	0.2000 % BGB 0.2 10/22/23 79	150	0	0	150	EUR	102.17 %	180'119.88	0.08	a)
BE0000340498	2.1500 % BGB 2.15 06/22/66 80	50	0	0	50	EUR	144.31 %	84'803.43	0.04	a)
BE0000341504	0.8000 % BGB 0.8 06/22/27 81	0	100	0	100	EUR	107.65 %	126'520.54	0.05	a)
BE0000342510	0.5000 % BGB 0 1/2 10/22/24 82	0	121	0	121	EUR	103.97 %	147'856.50	0.06	a)
BE0000343526	2.2500 % BGB 2 1/4 06/22/57 83	35	34	0	69	EUR	143.55 %	116'412.41	0.05	a)
BE0000344532	1.4500 % BGB 1.45 06/22/37 84	65	0	0	65	EUR	117.06 %	89'427.04	0.04	a)
BE0000346552	1.2500 % BGB 1 1/4 04/22/33 86	190	0	0	190	EUR	114.11 %	254'814.60	0.11	a)
BE0000347568	0.9000 % BGB 0.9 06/22/29 87	60	80	0	140	EUR	109.28 %	179'810.78	0.08	a)
BE0000348574	1.7000 % BGB 1.7 06/22/50 88	40	30	0	70	EUR	124.03 %	102'036.20	0.04	a)
BE0000349580	0.1000 % BGB 0.1 06/22/30 89	100	0	0	100	EUR	102.10 %	119'997.65	0.05	a)
BE0000350596	0.4000 % BGB 0.4 06/22/40 90	30	72	0	102	EUR	98.02 %	117'506.49	0.05	a)
BE0000352618	0.0000 % BGB 0 10/22/31 92	0	50	0	50	EUR	99.95 %	58'735.38	0.02	a)
BE0000353624	0.6500 % BGB 0.65 06/22/71 93	0	70	0	70	EUR	86.16 %	70'884.41	0.03	a)
<b>BE</b>								<b>4'856'156.51</b>	<b>2.07</b>	
CA135087A610	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/23	190	0	0	190	CAD	102.66 %	155'188.21	0.07	a)
CA135087B451	2.5000 % CAN 2 1/2 06/01/24	230	0	0	230	CAD	106.25 %	194'438.16	0.08	a)
CA135087C939	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/64	50	0	0	50	CAD	123.07 %	48'959.30	0.02	a)
CA135087D358	2.7500 % CAN 2 3/4 12/01/48	170	0	0	170	CAD	116.09 %	157'017.86	0.07	a)
CA135087D507	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/25	100	0	0	100	CAD	106.05 %	84'376.81	0.04	a)
CA135087E679	1.5000 % CAN 1 1/2 06/01/26	135	0	0	135	CAD	102.48 %	110'076.26	0.05	a)
CA135087F585	0.7500 % CAN 0 3/4 09/01/21	100	0	100	0	CAD	0.00 %	0.00	0.00	
CA135087F825	1.0000 % CAN 1 06/01/27	100	0	0	100	CAD	99.17 %	78'902.02	0.03	a)
CA135087G328	0.5000 % CAN 0 1/2 03/01/22	270	0	270	0	CAD	0.00 %	0.00	0.00	
CA135087G732	1.0000 % CAN 1 09/01/22	200	0	0	200	CAD	101.15 %	160'951.58	0.07	a)
CA135087H235	2.0000 % CAN 2 06/01/28	100	0	0	100	CAD	104.91 %	83'469.79	0.04	a)
CA135087H490	1.7500 % CAN 1 3/4 03/01/23	80	82	0	162	CAD	102.86 %	132'573.58	0.06	a)
CA135087H722	2.0000 % CAN 2 12/01/51	65	130	0	195	CAD	100.43 %	155'821.58	0.07	a)
CA135087H987	2.0000 % CAN 2 09/01/23	50	120	0	170	CAD	103.98 %	140'640.73	0.06	a)
CA135087J397	2.2500 % CAN 2 1/4 06/01/29	0	138	0	138	CAD	106.55 %	116'985.70	0.05	a)
CA135087J546	2.2500 % CAN 2 1/4 03/01/24	0	199	0	199	CAD	104.86 %	166'025.71	0.07	a)
CA135087J967	1.5000 % CAN 1 1/2 09/01/24	100	0	0	100	CAD	103.13 %	82'052.75	0.03	a)
CA135087K379	1.2500 % CAN 1 1/4 06/01/30	0	235	0	235	CAD	97.70 %	182'674.94	0.08	a)
CA135087K528	1.2500 % CAN 1 1/4 03/01/25	100	0	0	100	CAD	101.99 %	81'150.49	0.03	a)
CA135087K866	1.5000 % CAN 1 1/2 05/01/22	65	0	0	65	CAD	101.35 %	52'414.77	0.02	a)
CA135087K940	0.5000 % CAN 0 1/2 09/01/25	90	190	0	280	CAD	98.29 %	218'969.65	0.09	a)
CA135087L286	0.2500 % CAN 0 1/4 08/01/22	0	100	0	100	CAD	100.09 %	79'632.41	0.03	a)
CA135087L369	0.2500 % CAN 0 1/4 11/01/22	0	170	0	170	CAD	100.07 %	135'348.05	0.06	a)
CA135087L518	0.2500 % CAN 0 1/4 03/01/26	0	90	0	90	CAD	96.38 %	69'016.11	0.03	a)
CA135087L773	0.2500 % CAN 0 1/4 02/01/23	0	195	0	195	CAD	100.02 %	155'182.36	0.07	a)
CA135087L856	0.2500 % CAN 0 1/4 05/01/23	0	199	0	199	CAD	99.93 %	158'219.92	0.07	a)

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
CA135087WL43	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/29 WL43	90	0	0	90	CAD	133.36 %	95'498.75	0.04	a)
CA135087XG49	5.7500 % CAN 5 3/4 06/01/33	320	0	0	320	CAD	144.31 %	367'409.95	0.16	a)
CA135087XW98	5.0000 % CAN 5 06/01/37	50	0	0	50	CAD	144.83 %	57'614.67	0.02	a)
CA135087YQ12	4.0000 % CAN 4 06/01/41	20	89	0	109	CAD	134.97 %	117'048.92	0.05	a)
CA135087ZS68	3.5000 % CAN 3 1/2 12/01/45	85	52	0	137	CAD	129.61 %	141'273.99	0.06	a)
CA135087ZU15	2.7500 % CAN 2 3/4 06/01/22	180	0	0	180	CAD	102.99 %	147'495.88	0.06	a)
<b>CA</b>								<b>3'926'430.90</b>	<b>1.67</b>	
DE0001030708	0.0000 % DBR 0 08/15/30 G	0	70	0	70	EUR	103.64 %	85'267.79	0.04	a)
DE0001030716	0.0000 % OBL 0 10/10/25 G	0	47	0	47	EUR	103.17 %	56'987.19	0.02	a)
DE0001102309	1.5000 % DBR 1 1/2 02/15/23	200	0	0	200	EUR	104.13 %	244'757.59	0.10	a)
DE0001102317	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/23	200	0	0	200	EUR	104.69 %	246'092.73	0.10	a)
DE0001102325	2.0000 % DBR 2 08/15/23	175	67	0	242	EUR	106.49 %	302'871.88	0.13	a)
DE0001102333	1.7500 % DBR 1 3/4 02/15/24	265	0	0	265	EUR	107.17 %	333'787.56	0.14	a)
DE0001102341	2.5000 % DBR 2 1/2 08/15/46	230	71	0	301	EUR	158.23 %	559'767.67	0.24	a)
DE0001102358	1.5000 % DBR 1 1/2 05/15/24	250	0	0	250	EUR	106.98 %	314'344.48	0.13	a)
DE0001102366	1.0000 % DBR 1 08/15/24	100	111	0	211	EUR	105.86 %	262'511.92	0.11	a)
DE0001102374	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/25	200	50	0	250	EUR	104.74 %	307'736.38	0.13	a)
DE0001102382	1.0000 % DBR 1 08/15/25	250	0	0	250	EUR	107.47 %	315'772.46	0.13	a)
DE0001102390	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/26	300	0	0	300	EUR	105.72 %	372'742.55	0.16	a)
DE0001102408	0.0000 % DBR 0 08/15/26	100	191	0	291	EUR	103.42 %	353'700.86	0.15	a)
DE0001102416	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/27	315	0	0	315	EUR	105.06 %	388'936.24	0.17	a)
DE0001102424	0.5000 % DBR 0 1/2 08/15/27	200	50	0	250	EUR	106.91 %	314'129.99	0.13	a)
DE0001102432	1.2500 % DBR 1 1/4 08/15/48	140	100	0	240	EUR	127.42 %	359'403.42	0.15	a)
DE0001102440	0.5000 % DBR 0 1/2 02/15/28	180	60	0	240	EUR	107.23 %	302'470.23	0.13	a)
DE0001102457	0.2500 % DBR 0 1/4 08/15/28	200	0	0	200	EUR	105.59 %	248'205.91	0.11	a)
DE0001102465	0.2500 % DBR 0 1/4 02/15/29	30	205	0	235	EUR	105.62 %	291'727.57	0.12	a)
DE0001102481	0.0000 % DBR 0 08/15/50	110	106	0	216	EUR	92.71 %	235'346.96	0.10	a)
DE0001102499	0.0000 % DBR 0 02/15/30	0	50	0	50	EUR	103.42 %	60'774.52	0.03	a)
DE0001102507	0.0000 % DBR 0 08/15/30	25	240	0	265	EUR	103.20 %	321'407.30	0.14	a)
DE0001102515	0.0000 % DBR 0 05/15/35	80	131	0	211	EUR	100.74 %	249'814.97	0.11	a)
DE0001102523	0.0000 % DBR 0 11/15/27	120	70	0	190	EUR	103.60 %	231'354.06	0.10	a)
DE0001102531	0.0000 % DBR 0 02/15/31	0	160	0	160	EUR	102.96 %	193'604.04	0.08	a)
DE0001104776	0.0000 % BKO 0 09/10/21	150	0	150	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001104784	0.0000 % BKO 0 12/10/21	50	0	50	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001104792	0.0000 % BKO 0 03/11/22	100	0	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001104800	0.0000 % BKO 0 06/10/22	0	150	0	150	EUR	100.78 %	177'669.39	0.08	a)
DE0001104818	0.0000 % BKO 0 09/16/22	0	200	0	200	EUR	100.97 %	237'341.48	0.10	a)
DE0001104826	0.0000 % BKO 0 12/15/22	0	120	0	120	EUR	101.16 %	142'667.21	0.06	a)
DE0001104834	0.0000 % BKO 0 03/10/23	0	139	0	139	EUR	101.34 %	165'558.42	0.07	a)
DE0001134922	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/24 94	0	100	0	100	EUR	119.32 %	140'238.58	0.06	a)
DE0001135044	6.5000 % DBR 6 1/2 07/04/27 97	70	59	0	129	EUR	145.23 %	220'180.11	0.09	a)
DE0001135069	5.6250 % DBR 5 5/8 01/04/28 98	130	51	0	181	EUR	142.53 %	303'210.37	0.13	a)
DE0001135085	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/28 98	100	0	0	100	EUR	139.16 %	163'551.74	0.07	a)
DE0001135143	6.2500 % DBR 6 1/4 01/04/30 00	495	0	0	495	EUR	159.71 %	929'117.64	0.40	a)
DE0001135176	5.5000 % DBR 5 1/2 01/04/31 00	150	52	0	202	EUR	158.20 %	375'572.57	0.16	a)
DE0001135226	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/34 03	170	60	0	230	EUR	166.22 %	449'311.63	0.19	a)
DE0001135275	4.0000 % DBR 4 01/04/37 05	215	0	0	215	EUR	164.48 %	415'632.13	0.18	a)
DE0001135325	4.2500 % DBR 4 1/4 07/04/39 2007	90	100	0	190	EUR	177.94 %	397'346.42	0.17	a)
DE0001135366	4.7500 % DBR 4 3/4 07/04/40 08	210	0	0	210	EUR	191.62 %	472'938.71	0.20	a)
DE0001135432	3.2500 % DBR 3 1/4 07/04/42	75	108	0	183	EUR	167.32 %	359'876.70	0.15	a)
DE0001135457	2.2500 % DBR 2 1/4 09/04/21	50	0	50	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001135465	2.0000 % DBR 2 01/04/22	250	0	250	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
DE0001135473	1.7500 % DBR 1 3/4 07/04/22	200	0	0	200	EUR	103.03 %	242'181.35	0.10	a)
DE0001135481	2.5000 % DBR 2 1/2 07/04/44	220	30	0	250	EUR	155.17 %	455'917.61	0.19	a)
DE0001135499	1.5000 % DBR 1 1/2 09/04/22	130	110	0	240	EUR	103.11 %	290'848.92	0.12	a)
DE0001141745	0.0000 % OBL 0 10/08/21 174	150	0	150	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	



## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DE0001141752	0.0000 % OBL 0 04/08/22 175	120	60	0	180	EUR	100.66 %	212'951.52	0.09	a)
DE0001141760	0.0000 % OBL 0 10/07/22 176	140	0	0	140	EUR	101.03 %	166'234.47	0.07	a)
DE0001141778	0.0000 % OBL 0 04/14/23 177	0	200	0	200	EUR	101.44 %	238'434.51	0.10	a)
DE0001141786	0.0000 % OBL 0 10/13/23 178	100	0	0	100	EUR	101.84 %	119'696.77	0.05	a)
DE0001141794	0.0000 % OBL 0 04/05/24 179	70	120	0	190	EUR	102.17 %	228'154.08	0.10	a)
DE0001141802	0.0000 % OBL 0 10/18/24 180	150	61	0	211	EUR	102.52 %	254'236.59	0.11	a)
DE0001141810	0.0000 % OBL 0 04/11/25 181	0	160	0	160	EUR	102.82 %	193'346.42	0.08	a)
DE0001141828	0.0000 % OBL 0 10/10/25 182	0	253	0	253	EUR	103.05 %	306'424.82	0.13	a)
DE0001141836	0.0000 % OBL 0 04/10/26 183	0	80	0	80	EUR	103.21 %	97'041.78	0.04	a)
<b>DE</b>								<b>14'709'198.21</b>	<b>6.26</b>	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	800	250	0	1'050	DKK	177.61 %	294'710.84	0.13	a)
DK0009923054	1.5000 % DGB 1 1/2 11/15/23	1'000	0	0	1'000	DKK	105.20 %	166'246.57	0.07	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	550	0	0	550	DKK	110.20 %	95'781.41	0.04	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27 10Y	400	250	0	650	DKK	105.29 %	108'152.72	0.05	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29 10YR	600	400	0	1'000	DKK	105.45 %	166'638.48	0.07	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52 30Y	0	250	0	250	DKK	94.69 %	37'409.82	0.02	a)
<b>DK</b>								<b>868'939.84</b>	<b>0.37</b>	
ES0000011868	6.0000 % SPGB 6 01/31/29	630	0	0	630	EUR	146.30 %	1'083'232.67	0.46	a)
ES00000120N0	4.9000 % SPGB 4.9 07/30/40	80	139	0	219	EUR	170.90 %	439'889.78	0.19	a)
ES00000121G2	4.8000 % SPGB 4.8 01/31/24	130	0	0	130	EUR	114.93 %	175'605.71	0.07	a)
ES00000121S7	4.7000 % SPGB 4.7 07/30/41	100	40	0	140	EUR	169.01 %	278'090.63	0.12	a)
ES00000122E5	4.6500 % SPGB 4.65 07/30/25	550	0	0	550	EUR	121.76 %	787'058.43	0.33	a)
ES00000123C7	5.9000 % SPGB 5.9 07/30/26	550	0	0	550	EUR	132.81 %	858'527.54	0.37	a)
ES00000123K0	5.8500 % SPGB 5.85 01/31/22	130	0	130	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
ES00000123U9	5.4000 % SPGB 5.4 01/31/23	120	100	0	220	EUR	110.86 %	286'636.20	0.12	a)
ES00000123X3	4.4000 % SPGB 4.4 10/31/23	200	0	0	200	EUR	112.65 %	264'795.96	0.11	a)
ES0000012411	5.7500 % SPGB 5 3/4 07/30/32	170	60	0	230	EUR	159.24 %	430'460.76	0.18	a)
ES00000124H4	5.1500 % SPGB 5.15 10/31/44	175	0	0	175	EUR	184.92 %	380'334.26	0.16	a)
ES00000124W3	3.8000 % SPGB 3.8 04/30/24	150	0	0	150	EUR	113.11 %	199'409.67	0.08	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	0	227	0	227	EUR	111.36 %	297'104.12	0.13	a)
ES00000127A2	1.9500 % SPGB 1.95 07/30/30	170	87	0	257	EUR	115.88 %	350'030.98	0.15	a)
ES00000128C6	2.9000 % SPGB 2.9 10/31/46	100	50	0	150	EUR	138.86 %	244'806.19	0.10	a)
ES00000128E2	3.4500 % SPGB 3.45 07/30/66	100	48	0	148	EUR	159.96 %	278'242.09	0.12	a)
ES00000128H5	1.3000 % SPGB 1.3 10/31/26	0	235	0	235	EUR	108.57 %	299'863.70	0.13	a)
ES00000128O1	0.4000 % SPGB 0.4 04/30/22	220	0	0	220	EUR	100.98 %	261'101.79	0.11	a)
ES00000128P8	1.5000 % SPGB 1 1/2 04/30/27	40	125	0	165	EUR	110.13 %	213'564.35	0.09	a)
ES00000128Q6	2.3500 % SPGB 2.35 07/30/33	100	80	0	180	EUR	121.84 %	257'756.65	0.11	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	270	0	0	270	EUR	151.95 %	482'174.05	0.21	a)
ES0000012A89	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/27	170	39	0	209	EUR	110.04 %	270'307.07	0.12	a)
ES0000012A97	0.4500 % SPGB 0.45 10/31/22	150	0	0	150	EUR	101.57 %	179'064.97	0.08	a)
ES0000012B39	1.4000 % SPGB 1.4 04/30/28	150	50	0	200	EUR	110.05 %	258'675.58	0.11	a)
ES0000012B47	2.7000 % SPGB 2.7 10/31/48 30Y	120	0	0	120	EUR	135.31 %	190'828.15	0.08	a)
ES0000012B62	0.3500 % SPGB 0.35 07/30/23	100	100	0	200	EUR	101.95 %	239'631.38	0.10	a)
ES0000012B88	1.4000 % SPGB 1.4 07/30/28	0	180	0	180	EUR	110.20 %	233'137.13	0.10	a)
ES0000012C46	0.0500 % SPGB 0.05 10/31/21	50	0	50	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
ES0000012E51	1.4500 % SPGB 1.45 04/30/29	0	72	0	72	EUR	110.85 %	93'803.41	0.04	a)
ES0000012E69	1.8500 % SPGB 1.85 07/30/35	30	20	0	50	EUR	116.08 %	68'213.55	0.03	a)
ES0000012E85	0.2500 % SPGB 0 1/4 07/30/24 5YR	120	0	0	120	EUR	102.24 %	144'198.57	0.06	a)
ES0000012F43	0.6000 % SPGB 0.6 10/31/29	100	100	0	200	EUR	103.81 %	244'007.76	0.10	a)
ES0000012F76	0.5000 % SPGB 0 1/2 04/30/30	130	50	0	180	EUR	102.60 %	217'047.19	0.09	a)
ES0000012F84	0.0000 % SPGB 0 04/30/23	130	50	0	180	EUR	101.01 %	213'681.38	0.09	a)
ES0000012F92	0.0000 % SPGB 0 01/31/25	0	200	0	200	EUR	101.44 %	238'436.86	0.10	a)
ES0000012G00	1.0000 % SPGB 1 10/31/50	50	104	0	154	EUR	93.63 %	169'457.01	0.07	a)
ES0000012G26	0.8000 % SPGB 0.8 07/30/27	120	73	0	193	EUR	105.72 %	239'799.98	0.10	a)
ES0000012G34	1.2500 % SPGB 1 1/4 10/31/30	120	100	0	220	EUR	109.24 %	282'451.20	0.12	a)
ES0000012G42	1.2000 % SPGB 1.2 10/31/40	70	50	0	120	EUR	104.07 %	146'781.22	0.06	a)

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
ES0000012G91	0.0000 % SPGB 0 01/31/26	0	83	0	83	EUR	101.33 %	98'843.99	0.04	a)
ES0000012H33	0.0000 % SPGB 0 05/31/24	0	91	0	91	EUR	101.31 %	108'354.01	0.05	a)
ES0000012H41	0.1000 % SPGB 0.1 04/30/31	0	144	0	144	EUR	97.72 %	165'378.71	0.07	a)
ES0000012H58	1.4500 % SPGB 1.45 10/31/71	0	50	0	50	EUR	92.30 %	54'238.70	0.02	a)
ES0000012I08	0.0000 % SPGB 0 01/31/28	0	34	0	34	EUR	100.23 %	40'051.15	0.02	a)
<b>ES</b>								<b>11'765'074.50</b>	<b>5.01</b>	
FI4000006176	4.0000 % RFGB 4 07/04/25	0	60	0	60	EUR	119.83 %	84'501.38	0.04	a)
FI4000037635	2.7500 % RFGB 2 3/4 07/04/28	50	0	0	50	EUR	122.99 %	72'273.61	0.03	a)
FI4000046545	2.6250 % RFGB 2 5/8 07/04/42	40	0	0	40	EUR	147.14 %	69'174.12	0.03	a)
FI4000047089	1.6250 % RFGB 1 5/8 09/15/22	50	0	0	50	EUR	103.31 %	60'711.64	0.03	a)
FI4000079041	2.0000 % RFGB 2 04/15/24	90	0	0	90	EUR	108.11 %	114'358.23	0.05	a)
FI4000148630	0.7500 % RFGB 0 3/4 04/15/31	140	0	0	140	EUR	108.78 %	178'979.84	0.08	a)
FI4000167317	0.8750 % RFGB 0 7/8 09/15/25	30	0	0	30	EUR	106.53 %	37'560.56	0.02	a)
FI4000197959	0.5000 % RFGB 0 1/2 04/15/26	50	0	0	50	EUR	105.31 %	61'883.41	0.03	a)
FI4000219787	0.0000 % RFGB 0 09/15/23	90	90	90	90	EUR	101.58 %	107'448.90	0.05	a)
FI4000242870	1.3750 % RFGB 1 3/8 04/15/47 30Y	30	0	0	30	EUR	123.85 %	43'667.39	0.02	a)
FI4000278551	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/27	50	0	0	50	EUR	106.15 %	62'378.21	0.03	a)
FI4000348727	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/28	0	30	0	30	EUR	106.30 %	37'478.76	0.02	a)
FI4000369467	0.5000 % RFGB 0 1/2 09/15/29	0	84	0	84	EUR	106.26 %	104'903.99	0.04	a)
FI4000415153	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/36	0	25	0	25	EUR	98.74 %	29'013.34	0.01	a)
FI4000440557	0.2500 % RFGB 0 1/4 09/15/40	20	0	0	20	EUR	98.43 %	23'137.10	0.01	a)
FI4000480488	0.1250 % RFGB 0 1/8 04/15/52	0	25	0	25	EUR	89.25 %	26'223.19	0.01	a)
<b>FI</b>								<b>1'113'693.67</b>	<b>0.47</b>	
FR0000187635	5.7500 % FRTR 5 3/4 10/25/32	240	117	0	357	EUR	166.10 %	696'923.08	0.30	a)
FR0000571085	8.5000 % FRTR 8 1/2 04/25/23	200	0	0	200	EUR	118.94 %	279'579.24	0.12	a)
FR0000571150	6.0000 % FRTR 6 10/25/25	235	97	0	332	EUR	130.31 %	508'467.06	0.22	a)
FR0000571218	5.5000 % FRTR 5 1/2 04/25/29	290	50	0	340	EUR	146.84 %	586'773.23	0.25	a)
FR0010070060	4.7500 % FRTR 4 3/4 04/25/35	210	63	0	273	EUR	163.23 %	523'732.62	0.22	a)
FR0010171975	4.0000 % FRTR 4 04/25/55	120	50	0	170	EUR	194.78 %	389'170.83	0.17	a)
FR0010371401	4.0000 % FRTR 4 10/25/38	205	40	0	245	EUR	161.74 %	465'726.04	0.20	a)
FR0010466938	4.2500 % FRTR 4 1/4 10/25/23	400	0	0	400	EUR	112.66 %	529'635.07	0.23	a)
FR0010773192	4.5000 % FRTR 4 1/2 04/25/41	260	127	0	387	EUR	177.17 %	805'838.75	0.34	a)
FR0010870956	4.0000 % FRTR 4 04/25/60	120	44	0	164	EUR	203.83 %	392'879.12	0.17	a)
FR0010916924	3.5000 % FRTR 3 1/2 04/25/26	250	165	0	415	EUR	120.49 %	587'687.02	0.25	a)
FR0011059088	3.2500 % FRTR 3 1/4 10/25/21	390	0	390	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0011196856	3.0000 % FRTR 3 04/25/22	500	0	0	500	EUR	103.85 %	610'272.08	0.26	a)
FR0011317783	2.7500 % FRTR 2 3/4 10/25/27	330	197	0	527	EUR	120.75 %	747'902.10	0.32	a)
FR0011337880	2.2500 % FRTR 2 1/4 10/25/22	280	60	0	340	EUR	104.57 %	417'862.14	0.18	a)
FR0011461037	3.2500 % FRTR 3 1/4 05/25/45	180	50	0	230	EUR	159.23 %	430'427.22	0.18	a)
FR0011486067	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/23	180	259	0	439	EUR	105.18 %	542'681.08	0.23	a)
FR0011619436	2.2500 % FRTR 2 1/4 05/25/24	290	0	0	290	EUR	109.10 %	371'851.68	0.16	a)
FR0011883966	2.5000 % FRTR 2 1/2 05/25/30	360	149	0	509	EUR	124.18 %	742'876.18	0.32	a)
FR0011962398	1.7500 % FRTR 1 3/4 11/25/24	200	120	0	320	EUR	108.64 %	408'589.06	0.17	a)
FR0012517027	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/25	300	50	0	350	EUR	104.46 %	429'699.71	0.18	a)
FR0012938116	1.0000 % FRTR 1 11/25/25	260	70	0	330	EUR	107.18 %	415'694.89	0.18	a)
FR0012993103	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/31	310	110	0	420	EUR	115.52 %	570'234.47	0.24	a)
FR0013131877	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/26	270	75	0	345	EUR	105.09 %	426'115.65	0.18	a)
FR0013154028	1.7500 % FRTR 1 3/4 05/25/66	80	40	0	120	EUR	130.89 %	184'601.28	0.08	a)
FR0013154044	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/36	220	148	0	368	EUR	113.96 %	492'886.88	0.21	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	290	96	0	386	EUR	103.91 %	471'402.24	0.20	a)
FR0013219177	0.0000 % FRTR 0 05/25/22	60	220	0	280	EUR	100.74 %	331'517.89	0.14	a)
FR0013234333	1.7500 % FRTR 1 3/4 06/25/39	170	90	0	260	EUR	123.53 %	377'478.99	0.16	a)
FR0013250560	1.0000 % FRTR 1 05/25/27	230	75	0	305	EUR	108.64 %	389'436.44	0.17	a)
FR0013257524	2.0000 % FRTR 2 05/25/48	190	60	0	250	EUR	131.84 %	387'377.33	0.16	a)
FR0013283686	0.0000 % FRTR 0 03/25/23	200	78	0	278	EUR	101.30 %	330'979.61	0.14	a)
FR0013286192	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/28	300	100	0	400	EUR	107.58 %	505'753.07	0.22	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
FR0013313582	1.2500 % FRTR 1 1/4 05/25/34	220	100	0	320	EUR	113.69 %	427'581.83	0.18	a)
FR0013341682	0.7500 % FRTR 0 3/4 11/25/28	260	100	0	360	EUR	107.72 %	455'770.11	0.19	a)
FR0013344751	0.0000 % FRTR 0 03/25/24	125	329	0	454	EUR	101.85 %	543'455.37	0.23	a)
FR0013398583	0.0000 % FRTR 0 02/25/22	50	40	90	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
FR0013404969	1.5000 % FRTR 1 1/2 05/25/50	190	80	0	270	EUR	119.19 %	378'225.30	0.16	a)
FR0013407236	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/29	220	215	0	435	EUR	105.74 %	540'599.40	0.23	a)
FR0013415627	0.0000 % FRTR 0 03/25/25	290	120	0	410	EUR	102.29 %	492'905.92	0.21	a)
FR0013451507	0.0000 % FRTR 0 11/25/29	300	50	0	350	EUR	101.29 %	416'659.81	0.18	a)
FR0013479102	0.0000 % FRTR 0 02/25/23	60	100	0	160	EUR	101.26 %	190'416.64	0.08	a)
FR0013480613	0.7500 % FRTR 0 3/4 05/25/52	70	194	0	264	EUR	98.41 %	305'344.54	0.13	a)
FR0013508470	0.0000 % FRTR 0 02/25/26	120	237	0	357	EUR	102.39 %	429'608.39	0.18	a)
FR0013515806	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/40	40	80	0	120	EUR	100.08 %	141'148.26	0.06	a)
FR0013516549	0.0000 % FRTR 0 11/25/30	70	355	0	425	EUR	100.52 %	502'097.90	0.21	a)
FR0014001N46	0.0000 % FRTR 0 02/25/24	0	133	0	133	EUR	101.76 %	159'065.40	0.07	a)
FR0014001NN8	0.5000 % FRTR 0 1/2 05/25/72	0	66	0	66	EUR	81.16 %	62'955.40	0.03	a)
FR0014002JM6	0.5000 % FRTR 0 1/2 06/25/44	0	80	0	80	EUR	97.97 %	92'116.82	0.04	a)
<b>FR</b>								<b>20'490'003.14</b>	<b>8.72</b>	
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	0	85	0	85	GBP	139.66 %	163'785.57	0.07	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	60	100	0	160	GBP	134.72 %	297'397.09	0.13	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	180	0	0	180	GBP	142.28 %	353'346.69	0.15	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	100	25	0	125	GBP	156.07 %	269'162.22	0.11	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	315	0	0	315	GBP	181.13 %	787'200.94	0.33	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	100	61	0	161	GBP	161.90 %	359'631.22	0.15	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	90	60	0	150	GBP	124.29 %	257'224.37	0.11	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	140	61	0	201	GBP	159.46 %	442'213.99	0.19	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	260	0	0	260	GBP	136.37 %	489'189.19	0.21	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	20	90	0	110	GBP	168.35 %	255'499.74	0.11	a)
GB00B3KJDQ49	4.0000 % UKT 4 03/07/22	305	0	305	0	GBP	0.00 %	0.00	0.00	
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	85	52	0	137	GBP	149.15 %	281'921.69	0.12	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	110	0	0	110	GBP	142.58 %	216'389.39	0.09	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	70	50	0	120	GBP	182.55 %	302'237.08	0.13	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	135	0	0	135	GBP	151.27 %	281'754.75	0.12	a)
GB00B6RNH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	90	25	0	115	GBP	160.98 %	255'419.72	0.11	a)
GB00B7L9SL19	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/22	165	0	0	165	GBP	102.45 %	233'227.94	0.10	a)
GB00B7Z53659	2.2500 % UKT 2 1/4 09/07/23	230	0	0	230	GBP	105.21 %	333'863.95	0.14	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	170	0	0	170	GBP	136.79 %	320'839.58	0.14	a)
GB00BBJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	120	39	0	159	GBP	179.96 %	394'782.39	0.17	a)
GB00BD0PCK97	0.5000 % UKT 0 1/2 07/22/22	75	170	0	245	GBP	100.63 %	340'156.07	0.14	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	0	60	0	60	GBP	112.39 %	93'038.69	0.04	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	150	25	0	175	GBP	102.53 %	247'556.12	0.11	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	180	0	0	180	GBP	104.43 %	259'347.73	0.11	a)
GB00BF0HZ991	0.7500 % UKT 0 3/4 07/22/23	0	100	0	100	GBP	101.50 %	140'039.55	0.06	a)
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/71	70	0	0	70	GBP	115.78 %	111'819.17	0.05	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	70	90	0	160	GBP	102.56 %	226'403.25	0.10	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	70	39	0	109	GBP	108.60 %	163'320.61	0.07	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	180	0	0	180	GBP	107.15 %	266'102.74	0.11	a)
GB00BHFH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	290	0	0	290	GBP	108.77 %	435'202.91	0.19	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	190	0	0	190	GBP	100.82 %	264'292.57	0.11	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	30	182	0	212	GBP	98.22 %	287'289.96	0.12	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	190	0	0	190	GBP	101.47 %	265'996.50	0.11	a)
GB00BL68HG94	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/23	185	80	0	265	GBP	100.05 %	365'803.31	0.16	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	0	198	0	198	GBP	98.77 %	269'820.48	0.11	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	20	60	0	80	GBP	75.29 %	83'102.09	0.04	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	90	157	0	247	GBP	81.60 %	278'081.29	0.12	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	0	140	0	140	GBP	96.68 %	186'745.15	0.08	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	0	217	0	217	GBP	99.79 %	298'766.17	0.13	a)

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	0	113	0	113	GBP	93.13 %	145'195.35	0.06	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	0	185	0	185	GBP	92.34 %	235'692.77	0.10	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	200	0	0	200	GBP	143.18 %	395'090.89	0.17	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	0	60	0	60	GBP	89.03 %	73'700.81	0.03	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	80	34	0	114	GBP	107.57 %	169'192.34	0.07	a)
GB00BYYMZX75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	120	0	0	120	GBP	141.31 %	233'960.14	0.10	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	80	43	0	123	GBP	105.73 %	179'423.69	0.08	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	110	110	0	220	GBP	107.45 %	326'147.28	0.14	a)
<b>GB</b>								<b>12'636'375.14</b>	<b>5.38</b>	
IE00B4S3JD47	3.9000 % IRISH 3.9 03/20/23	130	0	0	130	EUR	108.85 %	166'310.16	0.07	a)
IE00B4TV0D44	5.4000 % IRISH 5.4 03/13/25	140	0	0	140	EUR	123.61 %	203'389.55	0.09	a)
IE00B6X95T99	3.4000 % IRISH 3.4 03/18/24	0	40	0	40	EUR	111.80 %	52'559.21	0.02	a)
IE00BDHDPR44	0.9000 % IRISH 0.9 05/15/28	100	0	0	100	EUR	108.43 %	127'437.27	0.05	a)
IE00BFZRPZ02	1.3000 % IRISH 1.3 05/15/33	50	0	0	50	EUR	113.89 %	66'927.19	0.03	a)
IE00BFZRQ242	1.3500 % IRISH 1.35 03/18/31	0	50	0	50	EUR	113.64 %	66'780.28	0.03	a)
IE00BH3SQ895	1.1000 % IRISH 1.1 05/15/29	0	60	0	60	EUR	110.34 %	77'809.25	0.03	a)
IE00BH3SQB22	1.5000 % IRISH 1 1/2 05/15/50	15	20	0	35	EUR	119.33 %	49'086.80	0.02	a)
IE00BJ38CR43	2.4000 % IRISH 2.4 05/15/30	150	0	0	150	EUR	122.87 %	216'612.80	0.09	a)
IE00BKFCV345	0.4000 % IRISH 0.4 05/15/35	15	0	0	15	EUR	101.95 %	17'973.20	0.01	a)
IE00BMQ5JL65	0.0000 % IRISH 0 10/18/31	0	50	0	50	EUR	99.44 %	58'435.68	0.02	a)
IE00BV8C9186	2.0000 % IRISH 2 02/18/45	90	0	0	90	EUR	131.21 %	138'789.45	0.06	a)
IE00BV8C9418	1.0000 % IRISH 1 05/15/26	80	0	0	80	EUR	107.50 %	101'075.39	0.04	a)
IE00BV8C9B83	1.7000 % IRISH 1.7 05/15/37	40	0	0	40	EUR	121.09 %	56'926.60	0.02	a)
<b>IE</b>								<b>1'400'112.83</b>	<b>0.60</b>	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	0	150	0	150	ILS	131.09 %	58'965.09	0.03	a)
IL0011232720	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/22 0122	300	0	300	0	ILS	0.00 %	0.00	0.00	
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	250	0	0	250	ILS	161.62 %	121'166.04	0.05	a)
IL0011267478	4.2500 % ILGOV 4 1/4 03/31/23 0323	300	0	0	300	ILS	108.17 %	97'313.10	0.04	a)
IL0011308488	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/24 0324	0	80	0	80	ILS	110.46 %	26'499.54	0.01	a)
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	300	0	0	300	ILS	105.79 %	95'175.18	0.04	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	300	0	0	300	ILS	107.90 %	97'070.20	0.04	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	0	80	0	80	ILS	130.90 %	31'403.12	0.01	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	0	150	0	150	ILS	109.96 %	49'460.86	0.02	a)
IL0011550683	1.5000 % ILGOV 1 1/2 11/30/23 1123	0	300	0	300	ILS	103.45 %	93'069.31	0.04	a)
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	0	70	0	70	ILS	99.20 %	20'823.46	0.01	a)
<b>IL</b>								<b>690'945.90</b>	<b>0.29</b>	
IT0000366655	9.0000 % BTPS 9 11/01/23	0	115	0	115	EUR	123.96 %	167'544.97	0.07	a)
IT0001174611	6.5000 % BTPS 6 1/2 11/01/27	140	80	0	220	EUR	140.61 %	363'558.06	0.15	a)
IT0001278511	5.2500 % BTPS 5 1/4 11/01/29	640	0	0	640	EUR	140.09 %	1'053'745.62	0.45	a)
IT0001444378	6.0000 % BTPS 6 05/01/31	90	0	0	90	EUR	152.03 %	160'814.27	0.07	a)
IT0003256820	5.7500 % BTPS 5 3/4 02/01/33	1'010	0	0	1'010	EUR	155.33 %	1'843'855.33	0.78	a)
IT0003934657	4.0000 % BTPS 4 02/01/37	80	231	0	311	EUR	141.31 %	516'517.69	0.22	a)
IT0004286966	5.0000 % BTPS 5 08/01/39	85	0	0	85	EUR	161.32 %	161'154.21	0.07	a)
IT0004356843	4.7500 % BTPS 4 3/4 08/01/23	1'120	0	0	1'120	EUR	111.93 %	1'473'316.20	0.63	a)
IT0004513641	5.0000 % BTPS 5 03/01/25	160	50	0	210	EUR	120.06 %	296'330.53	0.13	a)
IT0004532559	5.0000 % BTPS 5 09/01/40	140	50	0	190	EUR	162.80 %	363'536.78	0.15	a)
IT0004644735	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/26	80	100	0	180	EUR	122.04 %	258'175.19	0.11	a)
IT0004759673	5.0000 % BTPS 5 03/01/22	120	0	120	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0004801541	5.5000 % BTPS 5 1/2 09/01/22	80	0	0	80	EUR	108.26 %	101'786.30	0.04	a)
IT0004848831	5.5000 % BTPS 5 1/2 11/01/22	0	200	0	200	EUR	109.21 %	256'699.42	0.11	a)
IT0004889033	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/28	180	44	0	224	EUR	131.94 %	347'361.33	0.15	a)
IT0004923998	4.7500 % BTPS 4 3/4 09/01/44	120	49	0	169	EUR	164.54 %	326'815.23	0.14	a)
IT0004953417	4.5000 % BTPS 4 1/2 03/01/24	250	0	0	250	EUR	113.81 %	334'401.05	0.14	a)
IT0005001547	3.7500 % BTPS 3 3/4 09/01/24	60	126	0	186	EUR	113.48 %	248'071.42	0.11	a)
IT0005045270	2.5000 % BTPS 2 1/2 12/01/24	200	0	0	200	EUR	109.71 %	257'875.65	0.11	a)
IT0005090318	1.5000 % BTPS 1 1/2 06/01/25	200	0	0	200	EUR	106.65 %	250'692.58	0.11	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IT0005127086	2.0000 % BTPS 2 12/01/25	350	0	0	350	EUR	109.45 %	450'237.60	0.19	a)
IT0005135840	1.4500 % BTPS 1.45 09/15/22	0	200	0	200	EUR	102.66 %	241'304.58	0.10	a)
IT0005162828	2.7000 % BTPS 2.7 03/01/47	350	0	0	350	EUR	124.24 %	511'074.04	0.22	a)
IT0005170839	1.6000 % BTPS 1.6 06/01/26	300	0	0	300	EUR	107.97 %	380'689.02	0.16	a)
IT0005172322	0.9500 % BTPS 0.95 03/15/23	300	0	0	300	EUR	102.54 %	361'546.70	0.15	a)
IT0005177909	2.2500 % BTPS 2 1/4 09/01/36	130	0	0	130	EUR	116.49 %	177'977.88	0.08	a)
IT0005210650	1.2500 % BTPS 1 1/4 12/01/26	350	0	0	350	EUR	106.38 %	437'588.69	0.19	a)
IT0005216491	0.3500 % BTPS 0.35 11/01/21	420	0	420	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
IT0005217390	2.8000 % BTPS 2.8 03/01/67	75	20	0	95	EUR	124.61 %	139'126.27	0.06	a)
IT0005240830	2.2000 % BTPS 2.2 06/01/27	80	50	0	130	EUR	112.31 %	171'591.13	0.07	a)
IT0005244782	1.2000 % BTPS 1.2 04/01/22	235	0	0	235	EUR	101.61 %	280'644.46	0.12	a)
IT0005246340	1.8500 % BTPS 1.85 05/15/24	0	120	0	120	EUR	106.46 %	150'153.01	0.06	a)
IT0005273013	3.4500 % BTPS 3.45 03/01/48	25	100	0	125	EUR	140.83 %	206'902.98	0.09	a)
IT0005274805	2.0500 % BTPS 2.05 08/01/27	200	0	0	200	EUR	111.49 %	262'062.43	0.11	a)
IT0005277444	0.9000 % BTPS 0.9 08/01/22	190	0	0	190	EUR	101.71 %	227'122.45	0.10	a)
IT0005282527	1.4500 % BTPS 1.45 11/15/24	200	0	0	200	EUR	105.87 %	248'865.75	0.11	a)
IT0005321325	2.9500 % BTPS 2.95 09/01/38	280	0	0	280	EUR	127.08 %	418'193.73	0.18	a)
IT0005323032	2.0000 % BTPS 2 02/01/28	200	0	0	200	EUR	111.57 %	262'250.81	0.11	a)
IT0005327306	1.4500 % BTPS 1.45 05/15/25	100	44	0	144	EUR	106.34 %	179'971.30	0.08	a)
IT0005340929	2.8000 % BTPS 2.8 12/01/28	0	191	0	191	EUR	118.19 %	265'308.10	0.11	a)
IT0005358806	3.3500 % BTPS 3.35 03/01/35	0	120	0	120	EUR	130.41 %	183'923.77	0.08	a)
IT0005363111	3.8500 % BTPS 3.85 09/01/49	70	75	0	145	EUR	150.72 %	256'860.40	0.11	a)
IT0005366007	1.0000 % BTPS 1 07/15/22	100	0	0	100	EUR	101.80 %	119'647.81	0.05	a)
IT0005367492	1.7500 % BTPS 1 3/4 07/01/24	0	162	0	162	EUR	106.36 %	202'515.55	0.09	a)
IT0005370306	2.1000 % BTPS 2.1 07/15/26	0	157	0	157	EUR	110.70 %	204'258.83	0.09	a)
IT0005377152	3.1000 % BTPS 3.1 03/01/40	100	25	0	125	EUR	130.03 %	191'025.10	0.08	a)
IT0005383309	1.3500 % BTPS 1.35 04/01/30	0	220	0	220	EUR	107.08 %	276'881.40	0.12	a)
IT0005384497	0.0500 % BTPS 0.05 01/15/23	0	170	0	170	EUR	100.77 %	201'335.26	0.09	a)
IT0005386245	0.3500 % BTPS 0.35 02/01/25	100	82	0	182	EUR	101.85 %	217'863.72	0.09	a)
IT0005390874	0.8500 % BTPS 0.85 01/15/27	60	95	0	155	EUR	104.05 %	189'543.56	0.08	a)
IT0005398406	2.4500 % BTPS 2.45 09/01/50 CAC	100	50	0	150	EUR	118.69 %	209'251.35	0.09	a)
IT0005402117	1.4500 % BTPS 1.45 03/01/36	60	50	0	110	EUR	105.36 %	136'214.20	0.06	a)
IT0005403396	0.9500 % BTPS 0.95 08/01/30	0	140	0	140	EUR	103.33 %	170'018.18	0.07	a)
IT0005408502	1.8500 % BTPS 1.85 07/01/25	0	150	0	150	EUR	108.15 %	190'657.30	0.08	a)
IT0005413171	1.6500 % BTPS 1.65 12/01/30	30	175	0	205	EUR	109.64 %	264'153.14	0.11	a)
IT0005416570	0.9500 % BTPS 0.95 09/15/27	0	170	0	170	EUR	104.52 %	208'821.95	0.09	a)
IT0005419848	0.5000 % BTPS 0 1/2 02/01/26	0	174	0	174	EUR	102.36 %	209'331.95	0.09	a)
IT0005421703	1.8000 % BTPS 1.8 03/01/41	0	120	0	120	EUR	107.35 %	151'405.16	0.06	a)
IT0005422891	0.9000 % BTPS 0.9 04/01/31	0	235	0	235	EUR	102.30 %	282'541.89	0.12	a)
IT0005424251	0.0000 % BTPS 0 01/15/24	0	140	0	140	EUR	100.76 %	165'790.55	0.07	a)
IT0005425233	1.7000 % BTPS 1.7 09/01/51	0	70	0	70	EUR	101.00 %	83'089.66	0.04	a)
IT0005433195	0.9500 % BTPS 0.95 03/01/37	0	90	0	90	EUR	97.38 %	103'008.03	0.04	a)
IT0005433690	0.2500 % BTPS 0 1/4 03/15/28	0	118	0	118	EUR	99.57 %	138'091.64	0.06	a)
IT0005438004	1.5000 % BTPS 1 1/2 04/30/45	0	79	0	79	EUR	100.48 %	93'294.93	0.04	a)
IT0005439275	0.0000 % BTPS 0 04/15/24	0	56	0	56	EUR	100.71 %	66'282.51	0.03	a)
<b>IT</b>								<b>18'670'670.60</b>	<b>7.95</b>	
JP1024091L27	0.1000 % JGB 0.1 02/01/22 409	30'000	0	30'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1024121L54	0.1000 % JGB 0.1 05/01/22 412	10'000	0	0	10'000	JPY	100.25 %	90'719.42	0.04	a)
JP1024131L60	0.1000 % JGB 0.1 06/01/22 413	0	10'000	0	10'000	JPY	100.26 %	90'736.61	0.04	a)
JP1024141L76	0.1000 % JGB 0.1 07/01/22 414	30'000	0	0	30'000	JPY	100.28 %	272'258.71	0.12	a)
JP1024151L81	0.1000 % JGB 0.1 08/01/22 415	9'000	0	0	9'000	JPY	100.30 %	81'693.09	0.03	a)
JP1024191LC8	0.1000 % JGB 0.1 12/01/22 419	0	20'000	0	20'000	JPY	100.38 %	181'674.13	0.08	a)
JP1024201M15	0.1000 % JGB 0.1 01/01/23 420	0	30'000	0	30'000	JPY	100.39 %	272'560.07	0.12	a)
JP1051311H38	0.1000 % JGB 0.1 03/20/22 131	30'000	0	0	30'000	JPY	100.21 %	272'060.52	0.12	a)
JP1051321H69	0.1000 % JGB 0.1 06/20/22 132	10'000	0	0	10'000	JPY	100.28 %	90'747.47	0.04	a)
JP1051331H91	0.1000 % JGB 0.1 09/20/22 133	30'000	0	0	30'000	JPY	100.33 %	272'391.74	0.12	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1051341HC3	0.1000 % JGB 0.1 12/20/22 134	0	12'000	0	12'000	JPY	100.39 %	109'016.43	0.05	a)
JP1051351J37	0.1000 % JGB 0.1 03/20/23 135	60'000	0	0	60'000	JPY	100.44 %	545'369.91	0.23	a)
JP1051381K12	0.1000 % JGB 0.1 12/20/23 138	10'000	0	0	10'000	JPY	100.68 %	91'112.18	0.04	a)
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	15'000	0	0	15'000	JPY	100.72 %	136'719.85	0.06	a)
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	0	30'000	0	30'000	JPY	100.77 %	273'570.02	0.12	a)
JP1051411KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/24 141	30'000	0	0	30'000	JPY	100.81 %	273'689.48	0.12	a)
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	0	10'000	0	10'000	JPY	100.85 %	91'266.03	0.04	a)
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	0	10'000	0	10'000	JPY	100.96 %	91'362.86	0.04	a)
JP1103191BC3	1.1000 % JGB 1.1 12/20/21 319	26'000	0	26'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1103201C19	1.0000 % JGB 1 12/20/21 320	50'000	0	50'000	0	JPY	0.00 %	0.00	0.00	
JP1103211C33	1.0000 % JGB 1 03/20/22 321	10'000	0	0	10'000	JPY	101.08 %	91'475.98	0.04	a)
JP1103221C56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/22 322	10'000	0	0	10'000	JPY	100.98 %	91'388.20	0.04	a)
JP1103231C62	0.9000 % JGB 0.9 06/20/22 323	15'000	0	0	15'000	JPY	101.25 %	137'446.10	0.06	a)
JP1103241C78	0.8000 % JGB 0.8 06/20/22 324	30'000	0	0	30'000	JPY	101.13 %	274'560.97	0.12	a)
JP1103251C91	0.8000 % JGB 0.8 09/20/22 325	25'000	40'000	0	65'000	JPY	101.36 %	596'252.69	0.25	a)
JP1103271D13	0.8000 % JGB 0.8 12/20/22 327	30'000	5'000	0	35'000	JPY	101.58 %	321'730.64	0.14	a)
JP1103291D68	0.8000 % JGB 0.8 06/20/23 329	10'000	11'000	0	21'000	JPY	102.06 %	193'954.40	0.08	a)
JP1103301D90	0.8000 % JGB 0.8 09/20/23 330	0	20'000	0	20'000	JPY	102.30 %	185'152.86	0.08	a)
JP1103311DB5	0.6000 % JGB 0.6 09/20/23 331	192'000	0	0	192'000	JPY	101.80 %	1'768'849.22	0.75	a)
JP1103331E36	0.6000 % JGB 0.6 03/20/24 333	0	15'000	0	15'000	JPY	102.21 %	138'742.48	0.06	a)
JP1103341E67	0.6000 % JGB 0.6 06/20/24 334	0	14'000	0	14'000	JPY	102.38 %	129'714.70	0.06	a)
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	15'000	0	0	15'000	JPY	102.20 %	138'738.40	0.06	a)
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	0	15'000	0	15'000	JPY	101.60 %	137'914.42	0.06	a)
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	127'000	0	0	127'000	JPY	102.20 %	1'174'548.38	0.50	a)
JP1103421G35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/26 342	10'000	0	0	10'000	JPY	100.97 %	91'371.00	0.04	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	10'000	0	0	10'000	JPY	100.97 %	91'372.81	0.04	a)
JP1103451GC0	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	32'500	0	0	32'500	JPY	101.01 %	297'082.23	0.13	a)
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	60'500	0	0	60'500	JPY	100.98 %	552'860.27	0.24	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	10'000	0	0	10'000	JPY	100.95 %	91'361.05	0.04	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	30'000	0	0	30'000	JPY	100.93 %	274'009.84	0.12	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	35'000	0	0	35'000	JPY	100.96 %	319'792.17	0.14	a)
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	0	15'000	0	15'000	JPY	100.85 %	136'901.75	0.06	a)
JP1103521JA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/28 352	15'000	0	0	15'000	JPY	100.80 %	136'833.88	0.06	a)
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	10'000	3'000	0	13'000	JPY	100.75 %	118'525.83	0.05	a)
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	20'000	0	0	20'000	JPY	100.77 %	182'380.01	0.08	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	20'000	0	0	20'000	JPY	100.71 %	182'275.04	0.08	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	10'000	26'000	0	36'000	JPY	100.58 %	327'665.02	0.14	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	30'000	0	0	30'000	JPY	100.50 %	272'850.57	0.12	a)
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	12'000	34'000	0	46'000	JPY	100.44 %	418'137.75	0.18	a)
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	0	41'000	0	41'000	JPY	100.29 %	372'116.59	0.16	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	0	40'000	0	40'000	JPY	100.13 %	362'457.77	0.15	a)
JP1200721494	2.1000 % JGB 2.1 09/20/24 72	0	13'000	0	13'000	JPY	107.78 %	126'803.48	0.05	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	0	25'000	0	25'000	JPY	109.95 %	248'755.55	0.11	a)
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	0	20'000	0	20'000	JPY	110.95 %	200'805.35	0.09	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	30'000	0	0	30'000	JPY	111.94 %	303'917.52	0.13	a)
JP1200881660	2.3000 % JGB 2.3 06/20/26 88	0	20'000	0	20'000	JPY	112.50 %	203'619.83	0.09	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	10'000	3'000	0	13'000	JPY	112.50 %	132'348.18	0.06	a)
JP12009216C0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/26 92	0	16'000	0	16'000	JPY	112.50 %	162'894.41	0.07	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	0	11'000	0	11'000	JPY	112.97 %	112'462.76	0.05	a)
JP1200971792	2.2000 % JGB 2.2 09/20/27 97	0	9'000	0	9'000	JPY	114.59 %	93'327.11	0.04	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	35'000	0	0	35'000	JPY	117.48 %	372'095.77	0.16	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	0	12'000	0	12'000	JPY	115.75 %	125'702.39	0.05	a)
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	10'000	0	0	10'000	JPY	114.64 %	103'746.56	0.04	a)
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	0	11'000	0	11'000	JPY	115.10 %	114'580.13	0.05	a)
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	12'000	0	0	12'000	JPY	116.69 %	126'726.46	0.05	a)
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	0	14'000	0	14'000	JPY	117.13 %	148'396.14	0.06	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	35'000	0	0	35'000	JPY	117.55 %	372'336.50	0.16	a)
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	15'000	0	0	15'000	JPY	117.97 %	160'133.42	0.07	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	0	10'000	0	10'000	JPY	119.26 %	107'924.84	0.05	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	20'000	0	0	20'000	JPY	118.36 %	214'233.40	0.09	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	0	10'000	0	10'000	JPY	117.88 %	106'675.97	0.05	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	0	9'000	0	9'000	JPY	116.04 %	94'513.81	0.04	a)
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	10'000	0	0	10'000	JPY	114.21 %	103'354.71	0.04	a)
JP1201211A94	1.9000 % JGB 1.9 09/20/30 121	0	12'000	0	12'000	JPY	117.23 %	127'305.29	0.05	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	0	9'000	0	9'000	JPY	116.29 %	94'712.54	0.04	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	15'000	0	0	15'000	JPY	119.41 %	162'092.24	0.07	a)
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	45'500	0	0	45'500	JPY	118.15 %	486'483.33	0.21	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	34'500	0	0	34'500	JPY	117.53 %	366'945.59	0.16	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	53'000	0	0	53'000	JPY	117.80 %	565'003.75	0.24	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	0	20'000	0	20'000	JPY	116.97 %	211'713.94	0.09	a)
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	10'000	0	0	10'000	JPY	115.89 %	104'878.69	0.04	a)
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	35'000	0	0	35'000	JPY	115.00 %	364'253.24	0.16	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	58'500	0	0	58'500	JPY	117.43 %	621'693.27	0.26	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	31'000	0	0	31'000	JPY	117.79 %	330'445.84	0.14	a)
JP1201421D22	1.8000 % JGB 1.8 12/20/32 142	0	11'000	0	11'000	JPY	118.94 %	118'400.77	0.05	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	10'000	0	0	10'000	JPY	116.82 %	105'715.79	0.04	a)
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	0	12'000	0	12'000	JPY	115.64 %	125'585.11	0.05	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	36'500	0	0	36'500	JPY	118.20 %	390'440.83	0.17	a)
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	10'000	0	0	10'000	JPY	118.40 %	107'149.28	0.05	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	10'000	0	0	10'000	JPY	116.38 %	105'318.51	0.04	a)
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	44'500	0	0	44'500	JPY	115.20 %	463'911.30	0.20	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	10'000	11'000	0	21'000	JPY	112.83 %	214'431.77	0.09	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	10'000	0	0	10'000	JPY	114.25 %	103'391.81	0.04	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	15'000	0	0	15'000	JPY	112.91 %	153'275.50	0.07	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	32'000	0	0	32'000	JPY	110.12 %	318'890.73	0.14	a)
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	15'000	0	0	15'000	JPY	101.35 %	137'576.41	0.06	a)
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	10'000	0	0	10'000	JPY	98.21 %	88'874.17	0.04	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	18'000	0	0	18'000	JPY	102.63 %	167'181.65	0.07	a)
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	20'000	0	0	20'000	JPY	104.05 %	188'329.33	0.08	a)
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	15'000	0	0	15'000	JPY	105.51 %	143'220.76	0.06	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	15'000	0	0	15'000	JPY	103.77 %	140'868.27	0.06	a)
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	10'000	10'000	0	20'000	JPY	103.70 %	187'697.66	0.08	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	15'000	0	0	15'000	JPY	103.64 %	140'683.65	0.06	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	0	20'000	0	20'000	JPY	101.97 %	184'553.77	0.08	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	0	20'000	0	20'000	JPY	101.71 %	184'084.99	0.08	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	0	21'000	0	21'000	JPY	105.04 %	199'625.35	0.08	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	10'000	15'000	0	25'000	JPY	101.50 %	229'640.18	0.10	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	10'000	10'000	0	20'000	JPY	99.00 %	179'192.69	0.08	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	10'000	20'000	0	30'000	JPY	98.86 %	268'406.22	0.11	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	0	33'000	0	33'000	JPY	98.72 %	294'804.86	0.13	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	0	40'000	0	40'000	JPY	100.55 %	363'981.75	0.15	a)
JP13000611B1	2.4000 % JGB 2.4 11/20/31 6	12'000	0	0	12'000	JPY	124.02 %	134'684.47	0.06	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	0	10'000	0	10'000	JPY	122.31 %	110'688.64	0.05	a)
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	39'000	0	0	39'000	JPY	127.76 %	450'910.40	0.19	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	10'000	0	0	10'000	JPY	128.73 %	116'500.40	0.05	a)
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	27'500	0	0	27'500	JPY	127.85 %	318'181.09	0.14	a)
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	0	10'000	0	10'000	JPY	128.67 %	116'441.58	0.05	a)
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	10'000	0	0	10'000	JPY	131.97 %	119'429.81	0.05	a)
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	0	15'000	0	15'000	JPY	132.34 %	179'640.20	0.08	a)
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	0	20'000	0	20'000	JPY	130.05 %	235'377.28	0.10	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	10'000	0	0	10'000	JPY	131.87 %	119'335.70	0.05	a)
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	0	15'000	0	15'000	JPY	134.07 %	181'998.11	0.08	a)
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	15'000	0	0	15'000	JPY	134.72 %	182'879.11	0.08	a)

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	0	20'000	0	20'000	JPY	133.71 %	242'016.19	0.10	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	0	22'000	0	22'000	JPY	132.36 %	263'524.05	0.11	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	166'000	0	0	166'000	JPY	131.14 %	1'970'126.24	0.84	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	0	35'000	0	35'000	JPY	133.33 %	422'315.21	0.18	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	20'000	15'000	0	35'000	JPY	128.39 %	406'668.16	0.17	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	20'000	0	0	20'000	JPY	132.62 %	240'027.05	0.10	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	25'000	0	0	25'000	JPY	129.37 %	292'683.14	0.12	a)
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	20'000	15'000	0	35'000	JPY	129.78 %	411'055.03	0.17	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	34'500	0	0	34'500	JPY	128.23 %	400'346.58	0.17	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	20'000	0	0	20'000	JPY	126.58 %	229'105.79	0.10	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	10'000	0	0	10'000	JPY	128.74 %	116'510.36	0.05	a)
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	35'000	0	0	35'000	JPY	124.72 %	395'053.23	0.17	a)
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	0	15'000	0	15'000	JPY	124.84 %	169'463.28	0.07	a)
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	10'000	0	0	10'000	JPY	124.96 %	113'086.83	0.05	a)
JP1300441E92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/44 44	17'000	0	0	17'000	JPY	125.08 %	192'424.54	0.08	a)
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	10'000	0	0	10'000	JPY	120.76 %	109'288.64	0.05	a)
JP1300471F60	1.6000 % JGB 1.6 06/20/45 47	10'000	0	0	10'000	JPY	123.11 %	111'414.43	0.05	a)
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	0	15'000	0	15'000	JPY	118.74 %	161'178.67	0.07	a)
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	20'000	0	0	20'000	JPY	104.94 %	189'927.52	0.08	a)
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	0	12'000	0	12'000	JPY	93.25 %	101'266.93	0.04	a)
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	9'500	10'000	0	19'500	JPY	97.82 %	172'623.46	0.07	a)
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	7'500	0	0	7'500	JPY	100.04 %	67'897.71	0.03	a)
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	10'000	0	0	10'000	JPY	104.77 %	94'814.44	0.04	a)
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	10'000	0	0	10'000	JPY	104.70 %	94'747.47	0.04	a)
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	15'000	0	0	15'000	JPY	104.62 %	142'015.33	0.06	a)
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	15'000	0	0	15'000	JPY	104.42 %	141'747.90	0.06	a)
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	10'000	9'000	0	19'000	JPY	104.33 %	179'397.75	0.08	a)
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	15'000	0	0	15'000	JPY	101.92 %	138'356.96	0.06	a)
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	8'000	17'000	0	25'000	JPY	106.76 %	241'547.41	0.10	a)
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	20'000	0	0	20'000	JPY	101.72 %	184'113.95	0.08	a)
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	10'000	10'000	0	20'000	JPY	96.41 %	174'488.62	0.07	a)
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	7'000	20'000	0	27'000	JPY	93.67 %	228'867.05	0.10	a)
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	0	20'000	0	20'000	JPY	98.39 %	178'075.94	0.08	a)
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	0	20'000	0	20'000	JPY	98.26 %	177'840.65	0.08	a)
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	0	32'000	0	32'000	JPY	100.85 %	292'065.76	0.12	a)
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	10'000	0	0	10'000	JPY	144.03 %	130'343.84	0.06	a)
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	10'000	0	0	10'000	JPY	139.93 %	126'630.72	0.05	a)
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	73'000	0	0	73'000	JPY	140.48 %	928'064.14	0.39	a)
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	0	14'000	0	14'000	JPY	140.98 %	178'619.65	0.08	a)
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	12'000	3'000	0	15'000	JPY	136.72 %	185'595.40	0.08	a)
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	8'000	0	0	8'000	JPY	134.87 %	97'640.50	0.04	a)
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	10'000	0	0	10'000	JPY	129.75 %	117'420.77	0.05	a)
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	15'000	0	0	15'000	JPY	121.57 %	165'023.01	0.07	a)
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	10'000	0	0	10'000	JPY	91.22 %	82'548.38	0.04	a)
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	20'000	0	0	20'000	JPY	106.71 %	193'145.62	0.08	a)
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	10'000	10'000	0	20'000	JPY	103.60 %	187'516.66	0.08	a)
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	20'000	10'000	0	30'000	JPY	93.64 %	254'237.00	0.11	a)
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	10'000	20'000	0	30'000	JPY	93.38 %	253'525.69	0.11	a)
<b>JP</b>								<b>39'533'987.10</b>	<b>16.82</b>	
MX0MGO000003	8.0000 % MBONO 8 12/07/23 M	20'000	0	0	20'000	MXN	106.61 %	104'214.62	0.04	a)
MX0MGO000078	10.0000 % MBONO 10 12/05/24 M 20	20'000	0	0	20'000	MXN	114.44 %	111'866.40	0.05	a)
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M 30	0	6'000	0	6'000	MXN	125.11 %	36'688.95	0.02	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M 20	50'000	0	0	50'000	MXN	106.76 %	260'894.52	0.11	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M 20	10'000	10'000	0	20'000	MXN	112.50 %	109'972.84	0.05	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M 30	15'000	0	0	15'000	MXN	110.27 %	80'841.56	0.03	a)
MX0MGO0000Q0	6.5000 % MBONO 6 1/2 06/09/22 M	43'000	0	0	43'000	MXN	102.04 %	214'454.78	0.09	a)



## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	17'500	0	0	17'500	MXN	101.47 %	86'787.43	0.04	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	23'100	0	0	23'100	MXN	105.39 %	118'986.79	0.05	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	3'400	10'000	0	13'400	MXN	103.03 %	67'474.59	0.03	a)
MX0MGO000128	6.7500 % MBONO 6 3/4 03/09/23 M	0	10'000	0	10'000	MXN	103.41 %	50'541.34	0.02	a)
MX0MGO000151	8.0000 % MBONO 8 09/05/24 M	0	20'000	0	20'000	MXN	107.37 %	104'951.38	0.04	a)
<b>MX</b>								<b>1'347'675.20</b>	<b>0.57</b>	
MYBMN1300033	3.4800 % MGS 3.48 03/15/23 0313	660	0	0	660	MYR	102.54 %	163'214.90	0.07	a)
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	500	0	0	500	MYR	105.40 %	127'097.55	0.05	a)
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	300	0	0	300	MYR	105.58 %	76'383.70	0.03	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	400	0	0	400	MYR	105.81 %	102'071.63	0.04	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	500	0	0	500	MYR	108.88 %	131'290.25	0.06	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	300	0	0	300	MYR	106.64 %	77'157.12	0.03	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	140	0	0	140	MYR	104.19 %	35'176.75	0.01	a)
<b>MY</b>								<b>712'391.90</b>	<b>0.30</b>	
NL0000102077	7.5000 % NETHER 7 1/2 01/15/23	30	65	0	95	EUR	114.71 %	128'077.22	0.05	a)
NL0000102234	4.0000 % NETHER 4 01/15/37	200	0	0	200	EUR	162.12 %	381'077.74	0.16	a)
NL0000102275	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/23	30	44	0	74	EUR	107.96 %	93'894.81	0.04	a)
NL0000102317	5.5000 % NETHER 5 1/2 01/15/28	140	0	0	140	EUR	140.87 %	231'789.39	0.10	a)
NL0009446418	3.7500 % NETHER 3 3/4 01/15/42	110	63	0	173	EUR	173.10 %	351'957.45	0.15	a)
NL0010060257	2.2500 % NETHER 2 1/4 07/15/22	100	0	0	100	EUR	103.73 %	121'913.38	0.05	a)
NL0010071189	2.5000 % NETHER 2 1/2 01/15/33	30	0	0	30	EUR	130.81 %	46'122.11	0.02	a)
NL0010418810	1.7500 % NETHER 1 3/4 07/15/23	200	0	0	200	EUR	105.61 %	248'245.87	0.11	a)
NL0010721999	2.7500 % NETHER 2 3/4 01/15/47	120	22	0	142	EUR	163.05 %	272'117.29	0.12	a)
NL0010733424	2.0000 % NETHER 2 07/15/24	170	0	0	170	EUR	108.85 %	217'482.52	0.09	a)
NL0011220108	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/25	100	68	0	168	EUR	103.80 %	204'952.69	0.09	a)
NL0011819040	0.5000 % NETHER 0 1/2 07/15/26	150	0	0	150	EUR	105.68 %	186'307.81	0.08	a)
NL0011896857	0.0000 % NETHER 0 01/15/22	100	0	100	0	EUR	0.00 %	0.00	0.00	
NL0012171458	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/27	80	65	0	145	EUR	107.80 %	183'710.41	0.08	a)
NL0012650469	0.0000 % NETHER 0 01/15/24	0	144	0	144	EUR	101.91 %	172'475.05	0.07	a)
NL0012818504	0.7500 % NETHER 0 3/4 07/15/28	100	37	0	137	EUR	108.48 %	174'669.57	0.07	a)
NL0013332430	0.2500 % NETHER 0 1/4 07/15/29	70	30	0	100	EUR	104.76 %	123'123.93	0.05	a)
NL0013552060	0.5000 % NETHER 0 1/2 01/15/40	0	132	0	132	EUR	106.21 %	164'773.11	0.07	a)
NL0014555419	0.0000 % NETHER 0 07/15/30	70	87	0	157	EUR	102.28 %	188'728.45	0.08	a)
NL00150006U0	0.0000 % NETHER 0 07/15/31	0	50	0	50	EUR	101.66 %	59'740.26	0.03	a)
NL0015031501	0.0000 % NETHER 0 01/15/27	0	125	0	125	EUR	102.90 %	151'172.36	0.06	a)
NL0015614579	0.0000 % NETHER 0 01/15/52	40	35	0	75	EUR	90.44 %	79'720.28	0.03	a)
<b>NL</b>								<b>3'782'051.70</b>	<b>1.61</b>	
NO0010705536	3.0000 % NGB 3 03/14/24 476	1'850	0	0	1'850	NOK	106.52 %	230'850.43	0.10	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	500	0	0	500	NOK	104.68 %	61'314.26	0.03	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	0	350	0	350	NOK	102.76 %	42'132.76	0.02	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	230	0	0	230	NOK	99.14 %	26'710.81	0.01	a)
<b>NO</b>								<b>361'008.26</b>	<b>0.15</b>	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	600	0	0	600	PLN	133.64 %	203'203.25	0.09	a)
PL0000107264	4.0000 % POLGB 4 10/25/23 1023	0	250	0	250	PLN	109.66 %	69'475.42	0.03	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	220	0	0	220	PLN	110.92 %	61'840.85	0.03	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	450	0	0	450	PLN	108.61 %	123'858.34	0.05	a)
PL0000110151	2.5000 % POLGB 2 1/2 01/25/23 0123	600	0	0	600	PLN	104.40 %	158'743.03	0.07	a)
PL0000111191	2.5000 % POLGB 2 1/2 04/25/24 0424	0	220	0	220	PLN	106.49 %	59'371.01	0.03	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	0	260	0	260	PLN	110.63 %	72'893.56	0.03	a)
PL0000112165	0.0000 % POLGB 0 07/25/22 0722	650	0	0	650	PLN	99.96 %	164'657.88	0.07	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	550	0	0	550	PLN	100.49 %	140'064.62	0.06	a)
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	0	180	0	180	PLN	97.17 %	44'324.89	0.02	a)
<b>PL</b>								<b>1'098'432.85</b>	<b>0.47</b>	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	750	0	0	750	SEK	145.99 %	125'616.37	0.05	a)
SE0003784461	3.5000 % SGB 3 1/2 06/01/22 #1054 1054	800	0	0	800	SEK	104.42 %	95'836.08	0.04	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
SE0004869071	1.5000 % SGB 1 1/2 11/13/23 #1057 1057	1'000	0	0	1'000	SEK	104.62 %	120'025.70	0.05	a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	0	750	0	750	SEK	110.89 %	95'412.62	0.04	a)
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	500	0	0	500	SEK	105.52 %	60'527.98	0.03	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	0	450	0	450	SEK	104.17 %	53'778.73	0.02	a)
<b>SE</b>								<b>551'197.48</b>	<b>0.23</b>	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	100	0	0	100	SGD	106.26 %	79'086.04	0.03	a)
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	40	0	0	40	SGD	111.96 %	33'331.35	0.01	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	70	0	0	70	SGD	102.52 %	53'411.73	0.02	a)
SG31B0000009	1.2500 % SIGB 1 1/4 10/01/21	100	0	100	0	SGD	0.00 %	0.00	0.00	
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	40	0	0	40	SGD	111.08 %	33'069.37	0.01	a)
SG3260987684	2.7500 % SIGB 2 3/4 07/01/23	120	0	0	120	SGD	104.77 %	93'572.49	0.04	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	0	75	0	75	SGD	115.44 %	64'438.82	0.03	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	50	0	0	50	SGD	109.97 %	40'923.64	0.02	a)
SG7J28931946	3.1250 % SIGB 3 1/8 09/01/22	0	75	0	75	SGD	103.73 %	57'902.28	0.02	a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	165	0	0	165	SGD	112.73 %	138'437.41	0.06	a)
SG7S30941627	3.0000 % SIGB 3 09/01/24	40	0	0	40	SGD	107.62 %	32'039.30	0.01	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	35	0	0	35	SGD	96.22 %	25'064.75	0.01	a)
<b>SG</b>								<b>651'277.18</b>	<b>0.28</b>	
US912810EQ77	6.2500 % T 6 1/4 08/15/23	300	0	0	300	USD	114.17 %	342'515.64	0.15	a)
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	725	0	0	725	USD	130.61 %	946'918.01	0.40	a)
US912810FE39	5.5000 % T 5 1/2 08/15/28	0	54	0	54	USD	128.38 %	69'322.50	0.03	a)
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	0	70	0	70	USD	127.22 %	89'053.13	0.04	a)
US912810FG86	5.2500 % T 5 1/4 02/15/29	0	49	0	49	USD	127.77 %	62'605.15	0.03	a)
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	80	0	0	80	USD	139.34 %	111'475.00	0.05	a)
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	0	77	0	77	USD	133.56 %	102'843.13	0.04	a)
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	175	0	0	175	USD	132.09 %	231'164.06	0.10	a)
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	0	100	0	100	USD	131.94 %	131'937.50	0.06	a)
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	0	100	0	100	USD	133.92 %	133'921.88	0.06	a)
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	300	0	0	300	USD	131.06 %	393'187.50	0.17	a)
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	100	0	0	100	USD	133.31 %	133'312.50	0.06	a)
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	100	0	0	100	USD	137.52 %	137'515.62	0.06	a)
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	100	0	0	100	USD	133.69 %	133'687.50	0.06	a)
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	0	100	0	100	USD	125.77 %	125'765.62	0.05	a)
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	0	200	0	200	USD	131.91 %	263'812.50	0.11	a)
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	450	0	0	450	USD	140.39 %	631'757.79	0.27	a)
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	0	118	0	118	USD	134.33 %	158'507.18	0.07	a)
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	0	152	0	152	USD	124.03 %	188'527.50	0.08	a)
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	100	0	0	100	USD	113.56 %	113'562.50	0.05	a)
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	100	0	0	100	USD	113.63 %	113'625.00	0.05	a)
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	0	170	0	170	USD	111.31 %	189'231.25	0.08	a)
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	250	0	0	250	USD	106.97 %	267'421.88	0.11	a)
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	250	0	0	250	USD	106.88 %	267'187.50	0.11	a)
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	175	0	0	175	USD	113.44 %	198'515.63	0.08	a)
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	230	0	0	230	USD	109.05 %	250'807.82	0.11	a)
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	180	0	0	180	USD	122.34 %	220'218.75	0.09	a)
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	190	0	0	190	USD	124.69 %	236'906.25	0.10	a)
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	290	0	0	290	USD	122.56 %	355'431.25	0.15	a)
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	190	100	0	290	USD	118.00 %	342'200.00	0.15	a)
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	290	0	0	290	USD	113.44 %	328'968.75	0.14	a)
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	130	150	0	280	USD	111.13 %	311'150.00	0.13	a)
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	180	150	0	330	USD	101.80 %	335'929.70	0.14	a)
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	200	0	0	200	USD	111.13 %	222'250.00	0.09	a)
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	210	0	0	210	USD	108.84 %	228'571.88	0.10	a)
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	80	100	0	180	USD	111.27 %	200'278.12	0.09	a)
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	280	0	0	280	USD	101.56 %	284'375.00	0.12	a)
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	180	150	0	330	USD	101.59 %	335'259.38	0.14	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	230	88	0	318	USD	96.73 %	307'615.33	0.13	a)
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	240	0	0	240	USD	108.91 %	261'375.00	0.11	a)
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	250	0	0	250	USD	111.59 %	278'984.38	0.12	a)
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	200	0	0	200	USD	111.58 %	223'156.24	0.09	a)
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	270	0	0	270	USD	106.55 %	287'676.58	0.12	a)
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	300	0	0	300	USD	106.59 %	319'781.25	0.14	a)
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	260	100	0	360	USD	111.75 %	402'300.00	0.17	a)
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	260	100	0	360	USD	114.34 %	411'637.50	0.18	a)
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	200	200	0	400	USD	111.88 %	447'500.00	0.19	a)
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	360	150	0	510	USD	119.73 %	610'645.34	0.26	a)
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	330	100	0	430	USD	112.03 %	481'734.38	0.21	a)
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	350	110	0	460	USD	109.48 %	503'628.15	0.21	a)
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	360	100	0	460	USD	96.41 %	443'468.75	0.19	a)
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	340	0	0	340	USD	99.05 %	336'759.39	0.14	a)
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	380	150	0	530	USD	91.17 %	483'210.96	0.21	a)
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	380	180	0	560	USD	75.22 %	421'225.00	0.18	a)
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	220	410	0	630	USD	77.77 %	489'923.41	0.21	a)
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	80	550	0	630	USD	81.09 %	510'890.63	0.22	a)
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	360	0	0	360	USD	81.39 %	293'006.23	0.12	a)
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	0	700	0	700	USD	83.03 %	581'218.75	0.25	a)
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	0	200	0	200	USD	84.84 %	169'687.50	0.07	a)
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	0	485	0	485	USD	88.39 %	428'694.51	0.18	a)
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	0	479	0	479	USD	93.14 %	446'145.39	0.19	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	600	0	0	600	USD	102.38 %	614'250.00	0.26	a)
US9128282D10	1.3750 % T 1 3/8 08/31/23	0	200	0	200	USD	102.77 %	205'531.24	0.09	a)
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	0	200	0	200	USD	105.53 %	211'062.50	0.09	a)
US9128282P40	1.8750 % T 1 7/8 07/31/22	250	0	0	250	USD	102.34 %	255'859.38	0.11	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	400	100	0	500	USD	105.92 %	529'609.40	0.23	a)
US9128282S88	1.6250 % T 1 5/8 08/31/22	650	0	0	650	USD	102.11 %	663'710.97	0.28	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	0	338	0	338	USD	104.72 %	353'949.38	0.15	a)
US9128282W90	1.8750 % T 1 7/8 09/30/22	500	0	0	500	USD	102.61 %	513'046.90	0.22	a)
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	200	0	0	200	USD	105.61 %	211'218.76	0.09	a)
US9128283C28	2.0000 % T 2 10/31/22	500	0	0	500	USD	102.94 %	514'687.50	0.22	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	0	250	0	250	USD	105.67 %	264'179.70	0.11	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	0	200	0	200	USD	106.20 %	212'406.24	0.09	a)
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	220	0	0	220	USD	107.19 %	235'812.50	0.10	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	600	0	0	600	USD	109.00 %	654'000.00	0.28	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	200	0	0	200	USD	108.19 %	216'375.00	0.09	a)
US9128284A52	2.6250 % T 2 5/8 02/28/23	0	200	0	200	USD	104.69 %	209'375.00	0.09	a)
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	0	200	0	200	USD	107.77 %	215'531.24	0.09	a)
US9128284L18	2.7500 % T 2 3/4 04/30/23	0	200	0	200	USD	105.31 %	210'625.00	0.09	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	250	310	0	560	USD	109.84 %	615'125.00	0.26	a)
US9128284S60	2.7500 % T 2 3/4 05/31/23	0	200	0	200	USD	105.50 %	211'000.00	0.09	a)
US9128284U17	2.6250 % T 2 5/8 06/30/23	500	0	0	500	USD	105.44 %	527'187.50	0.22	a)
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	650	0	0	650	USD	109.91 %	714'390.63	0.30	a)
US9128284X55	2.7500 % T 2 3/4 08/31/23	250	0	0	250	USD	106.06 %	265'156.25	0.11	a)
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	0	170	0	170	USD	108.56 %	184'556.25	0.08	a)
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	400	0	0	400	USD	109.73 %	438'937.52	0.19	a)
US9128285D82	2.8750 % T 2 7/8 09/30/23	400	0	0	400	USD	106.55 %	426'187.52	0.18	a)
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	200	0	0	200	USD	109.78 %	219'562.50	0.09	a)
US9128285K26	2.8750 % T 2 7/8 10/31/23	250	200	0	450	USD	106.70 %	480'164.04	0.20	a)
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	350	276	0	626	USD	111.75 %	699'555.00	0.30	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	0	250	0	250	USD	109.30 %	273'242.20	0.12	a)
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	250	0	0	250	USD	108.16 %	270'390.63	0.12	a)
US9128285U08	2.6250 % T 2 5/8 12/31/23	0	260	0	260	USD	106.34 %	276'493.75	0.12	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	200	0	0	200	USD	108.20 %	216'406.24	0.09	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	550	0	0	550	USD	108.09 %	594'515.63	0.25	a)

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US9128286C90	2.5000 % T 2 1/2 02/15/22	250	0	250	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	200	0	0	200	USD	107.63	215'250.00	0.09	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	0	250	0	250	USD	105.89	264'726.55	0.11	a)
US9128286H87	2.3750 % T 2 3/8 03/15/22	150	0	0	150	USD	102.19	153'281.25	0.07	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	200	0	0	200	USD	106.41	212'812.50	0.09	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	250	98	0	348	USD	105.70	367'846.86	0.16	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	100	0	0	100	USD	107.03	107'031.25	0.05	a)
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	500	0	0	500	USD	106.20	531'015.60	0.23	a)
US9128286U98	2.1250 % T 2 1/8 05/15/22	150	0	0	150	USD	102.28	153'421.88	0.07	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	100	100	0	200	USD	105.75	211'500.00	0.09	a)
US9128286Y11	1.7500 % T 1 3/4 06/15/22	0	290	0	290	USD	101.97	295'709.38	0.13	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	300	0	0	300	USD	104.25	312'750.00	0.13	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	250	0	0	250	USD	104.47	261'171.88	0.11	a)
US9128287C81	1.7500 % T 1 3/4 07/15/22	100	0	0	100	USD	102.11	102'109.38	0.04	a)
US912828B667	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	1'010	0	0	1'010	USD	106.94	1'080'068.75	0.46	a)
US912828D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	900	0	0	900	USD	106.41	957'656.25	0.41	a)
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	1'205	0	0	1'205	USD	106.09	1'278'429.69	0.54	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	450	150	0	600	USD	105.28	631'687.50	0.27	a)
US912828J439	1.7500 % T 1 3/4 02/28/22	100	0	100	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828J769	1.7500 % T 1 3/4 03/31/22	250	0	0	250	USD	101.66	254'140.63	0.11	a)
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	300	200	0	500	USD	105.33	526'640.60	0.22	a)
US912828L575	1.7500 % T 1 3/4 09/30/22	200	0	0	200	USD	102.42	204'843.76	0.09	a)
US912828M490	1.8750 % T 1 7/8 10/31/22	100	100	0	200	USD	102.73	205'468.76	0.09	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	500	0	0	500	USD	106.44	532'187.50	0.23	a)
US912828M805	2.0000 % T 2 11/30/22	750	0	0	750	USD	103.08	773'085.90	0.33	a)
US912828N308	2.1250 % T 2 1/8 12/31/22	550	0	0	550	USD	103.44	568'906.25	0.24	a)
US912828P386	1.7500 % T 1 3/4 01/31/23	500	0	0	500	USD	102.91	514'531.25	0.22	a)
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	400	150	0	550	USD	103.38	568'562.50	0.24	a)
US912828P790	1.5000 % T 1 1/2 02/28/23	150	0	0	150	USD	102.55	153'820.32	0.07	a)
US912828Q293	1.5000 % T 1 1/2 03/31/23	600	0	0	600	USD	102.64	615'843.72	0.26	a)
US912828R283	1.6250 % T 1 5/8 04/30/23	200	0	0	200	USD	102.98	205'968.76	0.09	a)
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	600	0	0	600	USD	103.25	619'500.00	0.26	a)
US912828R697	1.6250 % T 1 5/8 05/31/23	150	0	0	150	USD	103.06	154'593.75	0.07	a)
US912828RR30	2.0000 % T 2 11/15/21	3'950	0	3'950	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828S927	1.2500 % T 1 1/4 07/31/23	0	200	0	200	USD	102.41	204'812.50	0.09	a)
US912828SV33	1.7500 % T 1 3/4 05/15/22	200	0	0	200	USD	101.84	203'687.50	0.09	a)
US912828T263	1.3750 % T 1 3/8 09/30/23	0	300	0	300	USD	102.84	308'531.25	0.13	a)
US912828TJ95	1.6250 % T 1 5/8 08/15/22	250	0	0	250	USD	102.06	255'156.25	0.11	a)
US912828TY62	1.6250 % T 1 5/8 11/15/22	0	450	0	450	USD	102.39	460'757.79	0.20	a)
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	500	0	0	500	USD	104.88	524'375.00	0.22	a)
US912828U576	2.1250 % T 2 1/8 11/30/23	480	0	0	480	USD	104.91	503'550.00	0.21	a)
US912828UN88	2.0000 % T 2 02/15/23	650	0	0	650	USD	103.42	672'242.22	0.29	a)
US912828V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	200	0	0	200	USD	105.31	210'625.00	0.09	a)
US912828V723	1.8750 % T 1 7/8 01/31/22	250	0	250	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	530	0	0	530	USD	105.44	558'818.75	0.24	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	400	0	0	400	USD	106.16	424'625.00	0.18	a)
US912828VB32	1.7500 % T 1 3/4 05/15/23	700	0	0	700	USD	103.28	722'968.75	0.31	a)
US912828VS66	2.5000 % T 2 1/2 08/15/23	0	350	0	350	USD	105.41	368'921.88	0.16	a)
US912828W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	0	100	0	100	USD	105.16	105'156.25	0.04	a)
US912828W556	1.8750 % T 1 7/8 02/28/22	400	0	400	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	450	0	0	450	USD	105.25	473'625.00	0.20	a)
US912828W895	1.8750 % T 1 7/8 03/31/22	200	0	0	200	USD	101.78	203'562.50	0.09	a)
US912828WE61	2.7500 % T 2 3/4 11/15/23	840	0	0	840	USD	106.48	894'468.79	0.38	a)
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	450	107	0	557	USD	106.56	593'553.13	0.25	a)
US912828X471	1.8750 % T 1 7/8 04/30/22	1'000	0	0	1'000	USD	101.92	1'019'218.80	0.43	a)
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	150	100	0	250	USD	104.94	262'343.75	0.11	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	110	400	0	510	USD	106.81	544'743.75	0.23	a)

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	1'850	0	0	1'850	USD	105.81 %	1'957'531.25	0.83	a)
US912828XD79	1.8750 % T 1 7/8 05/31/22	500	0	0	500	USD	102.06 %	510'312.50	0.22	a)
US912828XG01	2.1250 % T 2 1/8 06/30/22	850	0	0	850	USD	102.50 %	871'250.00	0.37	a)
US912828XQ82	2.0000 % T 2 07/31/22	150	100	0	250	USD	102.52 %	256'289.05	0.11	a)
US912828XR65	1.7500 % T 1 3/4 05/31/22	0	270	0	270	USD	101.91 %	275'146.88	0.12	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	400	0	0	400	USD	104.98 %	419'937.52	0.18	a)
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	120	100	0	220	USD	105.05 %	231'103.14	0.10	a)
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	0	150	0	150	USD	108.47 %	162'703.13	0.07	a)
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	0	200	0	200	USD	109.03 %	218'062.50	0.09	a)
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	0	232	0	232	USD	104.41 %	242'222.50	0.10	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	500	0	0	500	USD	100.28 %	501'406.25	0.21	a)
US912828YC87	1.5000 % T 1 1/2 08/31/21	500	0	500	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	200	0	0	200	USD	101.69 %	203'375.00	0.09	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	250	0	0	250	USD	102.56 %	256'406.25	0.11	a)
US912828YF19	1.5000 % T 1 1/2 09/15/22	250	0	0	250	USD	101.98 %	254'960.95	0.11	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	400	0	0	400	USD	102.94 %	411'750.00	0.18	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	250	0	0	250	USD	103.44 %	258'593.75	0.11	a)
US912828YK04	1.3750 % T 1 3/8 10/15/22	0	200	0	200	USD	101.91 %	203'812.50	0.09	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	450	0	0	450	USD	101.13 %	455'062.50	0.19	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	200	0	0	200	USD	102.78 %	205'562.50	0.09	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	120	200	0	320	USD	103.38 %	330'800.00	0.14	a)
US912828YW42	1.6250 % T 1 5/8 12/15/22	0	250	0	250	USD	102.52 %	256'289.05	0.11	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	140	100	0	240	USD	103.44 %	248'250.00	0.11	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	450	0	0	450	USD	104.28 %	469'265.63	0.20	a)
US912828ZZ94	1.5000 % T 1 1/2 01/15/23	0	235	0	235	USD	102.39 %	240'617.96	0.10	a)
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	250	0	0	250	USD	102.86 %	257'148.45	0.11	a)
US912828Z609	1.3750 % T 1 3/8 01/31/22	450	0	450	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	140	63	0	203	USD	101.91 %	206'869.69	0.09	a)
US912828Z864	1.3750 % T 1 3/8 02/15/23	0	200	0	200	USD	102.27 %	204'531.24	0.09	a)
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	200	205	0	405	USD	98.70 %	399'747.64	0.17	a)
US912828ZA13	1.1250 % T 1 1/8 02/28/22	250	0	250	0	USD	0.00 %	0.00	0.00	
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	100	0	0	100	USD	99.67 %	99'671.88	0.04	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	300	70	0	370	USD	101.84 %	376'821.88	0.16	a)
US912828ZD51	0.5000 % T 0 1/2 03/15/23	0	350	0	350	USD	100.64 %	352'242.17	0.15	a)
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	220	0	0	220	USD	96.63 %	212'575.00	0.09	a)
US912828ZF00	0.5000 % T 0 1/2 03/31/25	0	400	0	400	USD	99.31 %	397'250.00	0.17	a)
US912828ZG82	0.3750 % T 0 3/8 03/31/22	150	160	0	310	USD	100.30 %	310'920.33	0.13	a)
US912828ZH65	0.2500 % T 0 1/4 04/15/23	300	0	0	300	USD	100.16 %	300'468.75	0.13	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	200	100	0	300	USD	95.72 %	287'156.25	0.12	a)
US912828ZP81	0.1250 % T 0 1/8 05/15/23	100	0	0	100	USD	99.86 %	99'859.38	0.04	a)
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	500	250	0	750	USD	90.94 %	682'031.25	0.29	a)
US912828ZR48	0.1250 % T 0 1/8 05/31/22	150	0	0	150	USD	100.03 %	150'046.88	0.06	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	250	69	0	319	USD	95.53 %	304'744.69	0.13	a)
US912828ZU76	0.2500 % T 0 1/4 06/15/23	0	300	0	300	USD	100.11 %	300'328.14	0.13	a)
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	300	0	0	300	USD	95.38 %	286'125.00	0.12	a)
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	0	400	0	400	USD	97.94 %	391'750.00	0.17	a)
US912828ZX16	0.1250 % T 0 1/8 06/30/22	150	0	0	150	USD	100.02 %	150'023.43	0.06	a)
US912828ZY98	0.1250 % T 0 1/8 07/15/23	0	350	0	350	USD	99.80 %	349'289.08	0.15	a)
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	350	205	0	555	USD	97.78 %	542'685.94	0.23	a)
US91282CAC55	0.1250 % T 0 1/8 07/31/22	0	200	0	200	USD	100.02 %	200'031.24	0.09	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	300	100	0	400	USD	94.41 %	377'625.00	0.16	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	380	575	0	955	USD	90.56 %	864'871.88	0.37	a)
US91282CAF86	0.1250 % T 0 1/8 08/15/23	0	350	0	350	USD	99.75 %	349'125.00	0.15	a)
US91282CAG69	0.1250 % T 0 1/8 08/31/22	0	450	0	450	USD	100.00 %	450'000.00	0.19	a)
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	50	320	0	370	USD	95.02 %	351'557.79	0.15	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	200	200	0	400	USD	97.63 %	390'500.00	0.17	a)
US91282CAK71	0.1250 % T 0 1/8 09/15/23	0	200	0	200	USD	99.72 %	199'437.50	0.08	a)

Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung: USD

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	0	420	0	420	USD	94.05 %	394'996.90	0.17	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	0	490	0	490	USD	97.50 %	477'750.00	0.20	a)
US91282CAN11	0.1250 % T 0 1/8 09/30/22	0	200	0	200	USD	99.98 %	199'968.76	0.09	a)
US91282CAP68	0.1250 % T 0 1/8 10/15/23	0	400	0	400	USD	99.66 %	398'625.00	0.17	a)
US91282CAR25	0.1250 % T 0 1/8 10/31/22	0	450	0	450	USD	99.98 %	449'929.71	0.19	a)
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	0	500	0	500	USD	97.34 %	486'718.75	0.21	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	0	200	0	200	USD	94.67 %	189'343.76	0.08	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	0	1'144	0	1'144	USD	92.41 %	1'057'127.50	0.45	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	0	458	0	458	USD	99.94 %	457'713.75	0.19	a)
US91282CAX92	0.1250 % T 0 1/8 11/30/22	0	200	0	200	USD	99.97 %	199'937.50	0.09	a)
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	0	495	0	495	USD	95.31 %	471'796.88	0.20	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	0	500	0	500	USD	97.77 %	488'828.10	0.21	a)
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	0	430	0	430	USD	99.55 %	428'051.58	0.18	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	0	552	0	552	USD	95.16 %	525'262.50	0.22	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	0	540	0	540	USD	97.63 %	527'175.00	0.22	a)
US91282CBD20	0.1250 % T 0 1/8 12/31/22	0	550	0	550	USD	99.95 %	549'742.16	0.23	a)
US91282CBE03	0.1250 % T 0 1/8 01/15/24	0	594	0	594	USD	99.47 %	590'844.38	0.25	a)
US91282CBG50	0.1250 % T 0 1/8 01/31/23	0	575	0	575	USD	99.94 %	574'640.63	0.24	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	0	573	0	573	USD	97.47 %	558'495.94	0.24	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	0	582	0	582	USD	95.83 %	557'719.66	0.24	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	0	742	0	742	USD	94.39 %	700'378.40	0.30	a)
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	0	583	0	583	USD	98.25 %	572'797.50	0.24	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	0	620	0	620	USD	98.03 %	607'792.20	0.26	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	0	500	0	500	USD	99.73 %	498'670.00	0.21	a)
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	0	640	0	640	USD	98.95 %	633'299.20	0.27	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	0	712	0	712	USD	99.12 %	705'713.04	0.30	a)
US91282CBU45	0.1250 % T 0 1/8 03/31/23	0	400	0	400	USD	99.93 %	399'736.00	0.17	a)
<b>US</b>								<b>86'573'593.78</b>	<b>36.84</b>	

#### Derivative Finanzinstrumente

**0.00** **0.00**

Devisentermingeschaft	Wahrung	Kauf	Wahrung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
USD/CAD Verfall 03.11.2020	CAD	250'000	USD	187'515	0.00	0.00	
USD/JPY Verfall 13.11.2020	JPY	10'000'000	USD	95'061	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 13.11.2020	EUR	120'000	USD	141'853	0.00	0.00	
USD/AUD Verfall 13.11.2020	AUD	80'000	USD	58'185	0.00	0.00	
USD/GBP Verfall 13.11.2020	GBP	55'000	USD	72'871	0.00	0.00	
USD/EUR Verfall 30.12.2020	EUR	49'228	USD	60'000	0.00	0.00	
CHF/EUR Verfall 04.01.2021	EUR	52'611	CHF	57'000	0.00	0.00	

#### Devisentermingeschaft

**0.00** **0.00**

Class Hedge Devisentermingeschaft	Wahrung	Kauf	Wahrung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
MXN/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	139'441	MXN	3'366'100	0.00	0.00	
GBP/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	1'239'653	GBP	1'044'600	0.00	0.00	
SGD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	85'052	SGD	126'500	0.00	0.00	
EUR/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	7'764'170	EUR	7'207'800	0.00	0.00	
ILS/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	69'731	ILS	259'700	0.00	0.00	
PLN/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	119'708	PLN	504'200	0.00	0.00	
CAD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	351'558	CAD	511'500	0.00	0.00	
DKK/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	97'685	DKK	675'200	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	41'340	NOK	421'400	0.00	0.00	
SEK/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	55'859	SEK	544'500	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	8'400'971	USD	9'152'800	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	492'694	AUD	748'900	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 03.11.2020	CHF	15'067	USD	16'400	0.00	0.00	

Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswährung: USD

		Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % )	Kat.
CHF/EUR	Verfall 03.11.2020	EUR	1'800	CHF	1'942	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.11.2020	GBP	5'300	CHF	6'267	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.11.2020	CHF	4'526	EUR	4'200	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.11.2020	USD	1'400	CHF	1'279	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.11.2020	CHF	4'008'104	JPY	460'601'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.11.2020	CHF	17'698	JPY	2'034'400	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.11.2020	JPY	134'900	CHF	1'167	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	56'343	SEK	547'500	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	85'705	SGD	127'800	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	144'465	MXN	3'367'400	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	117'965	PLN	510'600	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	40'390	NOK	421'700	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	97'600	DKK	680'800	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	7'778'175	EUR	7'287'500	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	8'257'864	USD	9'016'700	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	69'744	ILS	259'400	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	1'246'852	GBP	1'052'900	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	375'136	CAD	546'200	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	487'818	AUD	758'500	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	4'092'428	JPY	467'044'200	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.12.2020	JPY	367'700	CHF	3'225	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.12.2020	GBP	7'800	CHF	9'253	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	9'092	EUR	8'500	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	5'695	USD	6'200	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	4'848	JPY	555'700	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.12.2020	USD	4'100	CHF	3'737	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	1'921	EUR	1'800	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.12.2020	EUR	3'000	CHF	3'215	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	1'894	JPY	216'700	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.12.2020	USD	4'100	CHF	3'713	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	8'666	ILS	32'300	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.12.2020	GBP	2'000	CHF	2'375	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.12.2020	JPY	158'800	CHF	1'378	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.12.2020	EUR	7'700	CHF	8'311	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	3'468	USD	3'800	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	5'320	GBP	4'400	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	5'974	AUD	9'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.12.2020	CAD	1'900	CHF	1'333	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.12.2020	AUD	2'600	CHF	1'725	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	3'777	EUR	3'500	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.12.2020	CAD	1'900	CHF	1'323	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.12.2020	GBP	3'600	CHF	4'319	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	7'328	JPY	843'300	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	4'248	JPY	486'600	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	1'322	GBP	1'100	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.12.2020	USD	8'300	CHF	7'581	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	10'397	USD	11'400	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.12.2020	EUR	4'300	CHF	4'644	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.12.2020	JPY	288'400	CHF	2'516	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.12.2020	USD	2'400	CHF	2'189	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.12.2020	JPY	477'900	CHF	4'195	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	10'364	EUR	9'600	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.12.2020	GBP	1'100	CHF	1'326	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	1'915	USD	2'100	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	4'296	JPY	493'900	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	8'324	EUR	7'700	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.12.2020	CHF	1'328	GBP	1'100	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.12.2020	USD	16'000	CHF	14'478	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	66'805	ILS	244'200	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	4'055'742	JPY	467'407'600	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	511'311	AUD	767'400	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	48'227	SEK	455'700	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	8'244'989	USD	9'121'400	0.00	0.00	

## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswahrung:

USD

		Wahrung	Kauf	Wahrung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
EUR/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	7'877'510	EUR	7'275'600	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	35'767	NOK	350'300	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	71'597	SGD	106'100	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	102'666	PLN	425'500	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	379'029	CAD	543'200	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	1'286'259	GBP	1'065'200	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	127'611	MXN	2'855'200	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	88'616	DKK	609'300	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2021	GBP	3'200	CHF	3'850	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2021	EUR	16'000	CHF	17'344	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	15'933	MXN	356'600	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	7'782	ILS	28'600	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.01.2021	USD	11'800	CHF	10'496	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2021	EUR	16'300	CHF	17'648	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	7'268	SEK	68'900	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.01.2021	JPY	658'100	CHF	5'646	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	11'855	MXN	265'900	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	6'405	SGD	9'600	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2021	GBP	7'600	CHF	9'130	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	11'977	PLN	49'500	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2021	EUR	2'100	CHF	2'272	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	4'360	USD	4'900	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.01.2021	JPY	134'200	CHF	1'147	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	1'178	CAD	1'700	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.01.2021	USD	6'900	CHF	6'126	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	1'586	AUD	2'400	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2021	GBP	2'700	CHF	3'194	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2021	EUR	8'800	CHF	9'490	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	14'007	JPY	1'640'400	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2021	EUR	6'500	CHF	6'997	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.01.2021	JPY	418'400	CHF	3'570	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	6'922	USD	7'800	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	9'351	EUR	8'700	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2021	GBP	1'200	CHF	1'430	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2021	GBP	4'000	CHF	4'707	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	3'047	JPY	358'800	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.01.2021	USD	4'800	CHF	4'254	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	4'705	USD	5'300	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.01.2021	EUR	3'700	CHF	4'010	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	8'422	USD	9'500	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.01.2021	JPY	238'900	CHF	2'048	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.01.2021	JPY	344'700	CHF	2'959	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	5'243	USD	5'900	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	4'549	EUR	4'200	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.01.2021	JPY	140'400	CHF	1'199	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.01.2021	USD	1'700	CHF	1'504	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	4'798	NOK	46'400	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	10'947	USD	12'400	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.01.2021	CHF	4'040	MXN	91'100	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	379'802	CAD	547'900	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	41'194	NOK	399'400	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	4'024'571	JPY	470'369'000	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	76'150	ILS	276'800	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	8'123'852	USD	9'199'400	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	114'063	PLN	481'200	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	526'740	AUD	772'800	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	57'054	SEK	530'400	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	89'294	DKK	614'800	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	78'375	SGD	117'300	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	7'945'670	EUR	7'348'800	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	1'296'715	GBP	1'074'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	1'194	GBP	1'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.02.2021	JPY	934'500	CHF	7'968	0.00	0.00	



## Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswährung:

USD

		Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % )	Kat.
CHF/USD	Verfall 02.02.2021	USD	5'800	CHF	5'098	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2021	EUR	14'300	CHF	15'435	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	2'297	SEK	21'400	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	191'189	JPY	22'438'300	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	15'328	CAD	22'100	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	3'135	SGD	4'700	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	406'370	USD	461'400	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	370'872	EUR	342'700	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	4'644	PLN	19'400	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	21'359	AUD	31'200	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	3'607	DKK	24'800	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	3'070	ILS	11'100	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	1'680	NOK	16'100	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	51'801	GBP	43'400	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2021	USD	11'600	CHF	10'263	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2021	EUR	1'600	CHF	1'736	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	18'453	GBP	15'400	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.02.2021	JPY	4'018'400	CHF	34'341	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2021	EUR	47'700	CHF	51'669	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.02.2021	GBP	5'600	CHF	6'732	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2021	USD	60'000	CHF	53'467	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.02.2021	JPY	208'800	CHF	1'783	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2021	EUR	3'300	CHF	3'562	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	7'453	USD	8'400	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	1'510	USD	1'700	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	14'753	GBP	12'200	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	1'284	PLN	5'400	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	4'254	CAD	6'100	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	5'951	AUD	8'700	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	121'132	USD	136'400	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	9'325	ILS	34'100	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	114'191	EUR	106'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	45'107	JPY	5'277'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2021	CHF	21'225	JPY	2'479'100	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2021	EUR	9'600	CHF	10'349	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.02.2021	GBP	1'400	CHF	1'701	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.02.2021	USD	4'000	CHF	3'554	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 03.02.2021	CHF	162'911	MXN	3'689'600	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 03.02.2021	CHF	6'625	MXN	149'100	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 03.02.2021	CHF	1'871	MXN	41'500	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	170'137	MXN	3'882'500	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	8'570'672	USD	9'641'300	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	81'778	SGD	122'100	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	86'076	ILS	317'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	551'043	AUD	807'800	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	93'127	DKK	641'100	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	1'372'338	GBP	1'124'100	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	43'481	NOK	418'400	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	4'183'261	JPY	492'554'000	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	59'344	SEK	556'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	8'305'074	EUR	7'685'400	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	120'821	PLN	505'400	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	395'913	CAD	568'900	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.03.2021	JPY	1'154'700	CHF	9'850	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.03.2021	GBP	7'500	CHF	9'173	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2021	EUR	21'300	CHF	23'050	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.03.2021	AUD	2'900	CHF	1'978	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2021	USD	42'800	CHF	38'313	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 02.03.2021	JPY	377'000	CHF	3'223	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	4'431	EUR	4'100	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	5'209	USD	5'800	0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 02.03.2021	MXN	186'300	CHF	8'268	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2021	EUR	4'200	CHF	4'548	0.00	0.00	

Halbjahresbericht per 31.03.2021

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

Valorennummer Klasse DA USD: 11 498 197 Valorennummer Klasse NTH CHF: 52 089 276

Valorennummer Klasse FA USD: 11 498 196 Valorennummer Klasse PV: 14 054 916

Valorennummer Klasse GT USD: 19 231 024

Valorennummer Klasse NT USD: 14 054 915

Rechnungswährung: USD

		Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % )	Kat.
CHF/JPY	Verfall 02.03.2021	JPY	270'500	CHF	2'309	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	9'539	USD	10'600	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.03.2021	EUR	1'900	CHF	2'053	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	5'713	USD	6'400	0.00	0.00	
CHF/PLN	Verfall 02.03.2021	PLN	23'500	CHF	5'667	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	8'229	SEK	76'500	0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 02.03.2021	ILS	14'800	CHF	4'054	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	9'774	DKK	67'100	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	14'082	EUR	13'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.03.2021	USD	23'800	CHF	21'353	0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 02.03.2021	SGD	5'700	CHF	3'848	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 02.03.2021	CAD	6'500	CHF	4'585	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.03.2021	GBP	4'400	CHF	5'506	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 02.03.2021	AUD	10'100	CHF	7'014	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 02.03.2021	NOK	19'500	CHF	2'060	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	14'777	JPY	1'742'500	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2021	CHF	12'529	USD	14'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	383'673	CAD	537'000	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	113'845	PLN	468'700	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	65'619	SEK	609'200	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	8'100'343	EUR	7'372'400	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	456'607	AUD	652'000	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	75'630	SGD	111'200	0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	80'713	ILS	295'500	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	8'381'016	USD	9'266'300	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	4'096'921	JPY	482'393'100	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	1'302'630	GBP	1'029'900	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	29'391	EUR	26'700	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	35'138	USD	38'500	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.04.2021	GBP	6'400	CHF	8'145	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.04.2021	AUD	6'300	CHF	4'478	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	7'770	USD	8'500	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.04.2021	EUR	1'300	CHF	1'435	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	1'741	USD	1'900	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.04.2021	EUR	2'300	CHF	2'547	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.04.2021	JPY	236'400	CHF	2'027	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.04.2021	AUD	3'600	CHF	2'597	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.04.2021	CAD	3'000	CHF	2'200	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	23'721	EUR	21'300	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.04.2021	JPY	267'800	CHF	2'302	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.04.2021	USD	9'900	CHF	9'152	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	1'675	USD	1'800	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	1'573	USD	1'700	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.04.2021	EUR	5'200	CHF	5'742	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.04.2021	GBP	2'100	CHF	2'704	0.00	0.00	
PLN/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	16'520	PLN	69'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.04.2021	JPY	989'800	CHF	8'405	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	2'874	USD	3'100	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.04.2021	GBP	1'100	CHF	1'423	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.04.2021	JPY	522'600	CHF	4'451	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	9'370	USD	10'100	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.04.2021	AUD	2'000	CHF	1'447	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.04.2021	USD	5'300	CHF	4'981	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	7'982	EUR	7'200	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	1'783	USD	1'900	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	1'941	CAD	2'600	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	6'335	GBP	4'900	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.04.2021	USD	7'700	CHF	7'262	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	2'221	AUD	3'100	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.04.2021	CHF	2'765	EUR	2'500	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.04.2021	JPY	1'244'800	CHF	10'644	0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 07.04.2021	CHF	153'097	MXN	3'553'500	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 07.04.2021	CHF	40'547	NOK	386'100	0.00	0.00	

	Wäh- rung	Kauf	Wäh- rung	Verkauf	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
DKK/CHF Verfall 07.04.2021	CHF	99'455	DKK	673'300	0.00	0.00	
NOK/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	74'267	NOK	674'200	0.00	0.00	a)
USD/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	17'380'705	USD	18'483'800	0.00	0.00	a)
SGD/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	133'370	SGD	190'600	0.00	0.00	a)
PLN/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	223'638	PLN	938'400	0.00	0.00	a)
CAD/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	794'866	CAD	1'062'400	0.00	0.00	a)
GBP/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	2'552'817	GBP	1'967'500	0.00	0.00	a)
MXN/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	275'422	MXN	6'012'300	0.00	0.00	a)
EUR/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	15'998'303	EUR	14'467'000	0.00	0.00	a)
ILS/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	144'321	ILS	511'700	0.00	0.00	a)
SEK/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	114'913	SEK	1'064'900	0.00	0.00	a)
AUD/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	867'992	AUD	1'211'800	0.00	0.00	a)
DKK/CHF Verfall 05.05.2021	CHF	175'059	DKK	1'177'500	0.00	0.00	a)
JPY/CHF Verfall 07.05.2021	CHF	7'971'693	JPY	936'559'300	0.00	0.00	a)

**Devisentermingeschäfte auf Klassen**

**0.00 0.00**

**Vermögensaufstellung**

	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'115'857.82	0.47
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	232'615'161.71	98.99
Sonstige Vermögenswerte	1'260'427.87	0.54
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>234'991'447.40</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-24'907'525.30	
Andere Verbindlichkeiten	-7'987.11	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>210'075'934.99</b>	

**Bewertungskategorien**

	Kurswert USD	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	232'615'161.71	98.99
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

**OTC Gegenparteien**

Zürcher Kantonalbank

**Umrechnungskurse**

AUD	1 = USD	0.76165000
CAD	1 = USD	0.79563989
DKK	1 = USD	0.15802906
EUR	1 = USD	1.17529529
GBP	1 = USD	1.37970000
ILS	1 = USD	0.29987705
JPY	1 = USD	0.00904977
MXN	1 = USD	0.04887466
MYR	1 = USD	0.24116725
NOK	1 = USD	0.11714609
PLN	1 = USD	0.25342119
SEK	1 = USD	0.11472758
SGD	1 = USD	0.74426913

## Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	49'627'971.63	23.62
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	31'175'655.12	14.84

\* 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.

## Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Ausgabespesen in % des Nettoinventar- wertes	Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Rücknahme- spesen in % des Nettoinventar- wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.10.2020 – 31.03.2021	0.00 - 0.12	0.00	0.104	0.00 - 0.03	0.00	0.006

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. 4 geregelt. 26)

## Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten:	0.00
Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten:	0.00
Hinweis auf Soft Commission Agreements:	Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

## Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission 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:

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF
DA USD	01.10.2020 – 31.03.2021	0.18 %	0.13 %	0.05 %
FA USD	01.10.2020 – 31.03.2021	0.20 %	0.10 %	0.10 %
GT USD	01.10.2020 – 31.03.2021	0.14 %	0.09 %	0.05 %
NT USD	01.10.2020 – 31.03.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %
NTH CHF	01.10.2020 – 31.03.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Gemäss Richtlinie für Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebühren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): 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.

## Benchmark

FTSE non-CHF World Government Bond Index

## TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der SFAMA - Swiss Funds & Asset Management Association (Stand: 20. April 2015) herausgegeben wurden, ermittelt.

## Erklärung der Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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 / Sacheilagen
- 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
- 21) Änderung von SSP auf Spread per 27.06.2018
- 26) Die Umstellung auf «Crossing Rate adjusted Spreads» (CRAS) bei den Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen erfolgte am 10.02.2020

## Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

---

1. Der Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 Anlagefonds gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens 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 aktuellen 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 ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit der Währung des Anlagefonds, oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens (Fondsvermögen 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 Anlagefonds 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 Nettovermögen, getätigt wurden.