

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

Jahresbericht per 28.02.2023

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	11704529	CHF
FA CHF	31562130	CHF
GT CHF	34282847	CHF
NT CHF	11704528	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 28.06.2023

Zürich, 28. Juni 2023

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

Swisscanto (CH) Index Fund V, Zürich

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

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

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible.

- ▶ Swissscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
- ▶ Swissscanto (CH) Index Commodity Fund

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

¹ Erfolgsrechnung für den Zeitraum vom 25. Februar 2022 bis 28. Februar 2023 für das Teilvermögen Swissscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 28. Februar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	3
2	Vertriebsorganisation	4
3	Abschlusszahlen	5
4	Collateral ausgeliehene Effekten	19
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	19
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	19
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
8	Pauschale Verwaltungskommission	20
9	Benchmark	20
10	TER	20
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	21
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	21
13	Fussnoten	21
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	22
	Pflichtpublikationen	24

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer

Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Abschlusszahlen

Übersicht

	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022	01.03.2020 28.02.2021	01.03.2019 29.02.2020
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		108'438'136.85	231'771'356.84	233'934'533.75	241'955'048.52
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		681'322.73	1'495'987.25	1'474'702.35	40'325.62
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'090.000	15'170.000	14'070.000	369.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		84.2179	98.6148	104.8118	109.2835
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		89.8564	107.4880	115.7758	112.9020
Thesaurierung je Anteil		1.49	1.63	1.82	1.97
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse FA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'029'038.52	1'362'230.53	1'334'560.63	81'805.63
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'492.167	15'089.733	13'735.595	798.174
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		76.2693	90.2753	97.1607	102.4910
Ausschüttung je Anteil		1.50	1.40	1.80	1.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.18 %	0.18 %	0.20 %	0.22 %
Klasse GT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		22'656'682.04	23'929'903.60	21'439'068.64	19'871'142.71
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		280'727.910	253'276.910	213'553.095	189'885.582
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		80.7069	94.4812	100.3922	104.6480
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		86.1103	102.9824	110.8939	108.1130
Thesaurierung je Anteil		1.46	1.61	1.79	1.93
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		84'071'093.56	204'983'235.46	209'686'202.13	221'961'774.56
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		981'831.347	2'046'613.651	1'972'101.662	2'004'490.683
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85.6268	100.1573	106.3263	110.7323
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		91.3596	109.1692	117.4487	114.3987
Thesaurierung je Anteil		1.68	1.85	2.04	2.19
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF	-14.05 %	-17.01 %	-4.25 %	0.34 %
Klasse FA CHF	-14.06 %	-17.01 %	-4.25 %	0.32 %
Klasse GT CHF	-14.02 %	-16.97 %	-4.21 %	0.38 %
Klasse NT CHF	-13.90 %	-16.86 %	-4.07 %	0.52 %
Benchmark	-14.01 %	-17.00 %	-4.11 %	0.51 %
Tracking Error 33)	0.10 %	0.09 %	0.03 %	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 Differenz

Klasse

Klasse DT CHF	-0.04 %
Klasse FA CHF	-0.05 %
Klasse GT CHF	-0.01 %
Klasse NT CHF	0.11 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichenden Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	28.02.2023	28.02.2022
Bankguthaben auf Sicht	255'298.38	638'968.51
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	61'467'769.59	129'667'372.62
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	46'308'741.29	100'811'756.41
Sonstige Vermögenswerte	408'997.20	656'229.96
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	108'440'806.46	231'774'327.50
Andere Verbindlichkeiten	-2'669.61	-2'970.66
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	108'438'136.85	231'771'356.84

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		15'170.000	14'070.000
Ausgegebene Anteile		-	1'100.000
Zurückgenommene Anteile		-7'080.000	-
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		8'090.000	15'170.000
Klasse FA CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		15'089.733	13'735.595
Ausgegebene Anteile		2'280.231	4'703.159
Zurückgenommene Anteile		-3'877.797	-3'349.021
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'492.167	15'089.733
Klasse GT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		253'276.910	213'553.095
Ausgegebene Anteile		44'648.900	53'666.934
Zurückgenommene Anteile		-17'197.900	-13'943.119
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		280'727.910	253'276.910
Klasse NT CHF	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'046'613.651	1'972'101.662
Ausgegebene Anteile		165'661.777	398'191.544
Zurückgenommene Anteile		-1'230'444.081	-323'679.555
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		981'831.347	2'046'613.651

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		231'771'356.84	233'934'533.75
Ausbezahlte Ausschüttung		-20'361.95	-24'495.23
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'169'822.27	-1'592'535.18
Saldo aus dem Anteilverkehr		-95'071'161.55	12'220'401.03
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-27'071'874.22	-12'766'547.53
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		108'438'136.85	231'771'356.84

Erfolgsrechnung

	von bis	01.03.2022 28.02.2023	01.03.2021 28.02.2022
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'560.62	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'179.52	-3'214.34
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'496'624.96	1'965'175.00
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'784'834.97	2'211'740.90
Erträge aus Wertpapierleihe		10'327.35	14'795.65
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		261'524.44	580'692.99
Total Ertrag		3'553'692.82	4'769'190.20
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-6.50
Reglementarische Vergütungen		-36'022.29	-37'680.98
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'423'339.35	-481'395.78
Total Aufwand		-1'459'361.64	-519'083.26
Nettoertrag / Verlust		2'094'331.18	4'250'106.94
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-19'551'422.22	-2'335'215.78
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		31'730.42	55'190.35
Realisierter Erfolg		-17'425'360.62	1'970'081.51
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-9'646'513.60	-14'736'629.04
Gesamterfolg		-27'071'874.22	-12'766'547.53

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	12'097.43	24'862.91
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	12'097.43	24'862.91
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	4'234.10	8'702.02
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	7'863.33	16'160.89
Total	12'097.43	24'862.91
Klasse FA CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	18'112.67	22'893.38
Vortrag des Vorjahres	2'772.80	1'005.05
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	20'885.47	23'898.43
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	20'238.25	21'125.63
Vortrag auf neue Rechnung	647.22	2'772.80
Total	20'885.47	23'898.43
Klasse GT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	411'840.94	407'775.93
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	411'840.94	407'775.93
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	144'144.33	142'721.58
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	267'696.61	265'054.35
Total	411'840.94	407'775.93
Klasse NT CHF	28.02.2023	28.02.2022
Nettoertrag	1'652'280.14	3'794'574.72
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'652'280.14	3'794'574.72
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	578'298.05	1'328'101.15
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'073'982.09	2'466'473.57
Total	1'652'280.14	3'794'574.72

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							61'467'769.59	56.68	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							61'467'769.59	56.68	
JP1024211M21	0.1000 % JGB 0.1 02/01/23 421	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024251M63	0.0050 % JGB 0.005 06/01/23 425	45'000	0	45'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024281M91	0.0050 % JGB 0.005 09/01/23 428	41'000	0	41'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1024391N89	0.0050 % JGB 0.005 08/01/24 439	0	9'000	0	9'000 JPY	100.08%	61'974.95	0.06	a)
JP1051351J37	0.1000 % JGB 0.1 03/20/23 135	35'000	0	35'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051361J76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/23 136	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051371JA0	0.1000 % JGB 0.1 09/20/23 137	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051381K12	0.1000 % JGB 0.1 12/20/23 138	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051391K44	0.1000 % JGB 0.1 03/20/24 139	20'000	0	10'000	10'000 JPY	100.16%	68'914.73	0.06	a)
JP1051401K75	0.1000 % JGB 0.1 06/20/24 140	33'000	0	13'000	20'000 JPY	100.20%	137'888.63	0.13	a)
JP1051421L13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/24 142	10'000	0	0	10'000 JPY	100.26%	68'982.85	0.06	a)
JP1051431L45	0.1000 % JGB 0.1 03/20/25 143	0	10'000	0	10'000 JPY	100.30%	69'010.37	0.06	a)
JP1051441L76	0.1000 % JGB 0.1 06/20/25 144	12'000	0	12'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051451LA6	0.1000 % JGB 0.1 09/20/25 145	30'000	0	20'000	10'000 JPY	100.30%	69'015.18	0.06	a)
JP1051461M13	0.1000 % JGB 0.1 12/20/25 146	33'000	0	23'000	10'000 JPY	100.30%	69'010.37	0.06	a)
JP1051471M45	0.0050 % JGB 0.005 03/20/26 147	35'000	0	25'000	10'000 JPY	99.98%	68'794.31	0.06	a)
JP1051481M76	0.0050 % JGB 0.005 06/20/26 148	40'000	0	40'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1051491MA0	0.0050 % JGB 0.005 09/20/26 149	30'000	0	10'000	20'000 JPY	99.82%	137'364.32	0.13	a)
JP1051511N46	0.0050 % JGB 0.005 03/20/27 151	0	13'000	0	13'000 JPY	99.54%	89'034.56	0.08	a)
JP1051521N69	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 152	0	17'000	0	17'000 JPY	99.92%	116'877.81	0.11	a)
JP1051531N75	0.0050 % JGB 0.005 06/20/27 153	0	42'000	0	42'000 JPY	99.41%	287'274.44	0.26	a)
JP1103281D37	0.6000 % JGB 0.6 03/20/23 328	60'000	0	60'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103291D68	0.8000 % JGB 0.8 06/20/23 329	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103301D90	0.8000 % JGB 0.8 09/20/23 330	39'000	0	39'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103321DC2	0.6000 % JGB 0.6 12/20/23 332	60'000	0	60'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103331E36	0.6000 % JGB 0.6 03/20/24 333	15'000	0	0	15'000 JPY	100.67%	103'904.65	0.10	a)
JP1103341E67	0.6000 % JGB 0.6 06/20/24 334	19'000	0	0	19'000 JPY	100.85%	131'847.88	0.12	a)
JP1103351E98	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/24 335	45'000	0	10'000	35'000 JPY	100.85%	242'877.67	0.22	a)
JP1103371F10	0.3000 % JGB 0.3 12/20/24 337	0	7'000	0	7'000 JPY	100.62%	48'461.87	0.04	a)
JP1103381F34	0.4000 % JGB 0.4 03/20/25 338	50'000	0	50'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103391F65	0.4000 % JGB 0.4 06/20/25 339	43'000	0	13'000	30'000 JPY	100.99%	208'471.92	0.19	a)
JP1103401F97	0.4000 % JGB 0.4 09/20/25 340	20'000	0	0	20'000 JPY	101.07%	139'085.86	0.13	a)
JP1103411FC6	0.3000 % JGB 0.3 12/20/25 341	20'000	0	10'000	10'000 JPY	100.86%	69'396.37	0.06	a)
JP1103431G66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/26 343	20'000	0	10'000	10'000 JPY	100.24%	68'969.77	0.06	a)
JP1103441G98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/26 344	18'000	0	18'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103451GC0	0.1000 % JGB 0.1 12/20/26 345	40'000	0	20'000	20'000 JPY	100.07%	137'702.85	0.13	a)
JP1103461H35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/27 346	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103471H66	0.1000 % JGB 0.1 06/20/27 347	25'000	0	15'000	10'000 JPY	99.81%	68'678.72	0.06	a)
JP1103481H98	0.1000 % JGB 0.1 09/20/27 348	30'000	0	0	30'000 JPY	99.65%	205'697.63	0.19	a)
JP1103491HC4	0.1000 % JGB 0.1 12/20/27 349	15'000	0	0	15'000 JPY	99.52%	102'712.58	0.09	a)
JP1103501J35	0.1000 % JGB 0.1 03/20/28 350	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103511J74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/28 351	11'000	0	11'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103531K10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/28 353	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103541K42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/29 354	11'000	0	5'000	6'000 JPY	98.56%	40'689.94	0.04	a)
JP1103551K72	0.1000 % JGB 0.1 06/20/29 355	12'000	0	12'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103561KA2	0.1000 % JGB 0.1 09/20/29 356	21'000	0	11'000	10'000 JPY	98.12%	67'511.76	0.06	a)
JP1103571L10	0.1000 % JGB 0.1 12/20/29 357	33'000	0	23'000	10'000 JPY	97.91%	67'369.33	0.06	a)
JP1103581L42	0.1000 % JGB 0.1 03/20/30 358	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103591L73	0.1000 % JGB 0.1 06/20/30 359	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103601LA4	0.1000 % JGB 0.1 09/20/30 360	70'000	0	60'000	10'000 JPY	97.14%	66'835.39	0.06	a)
JP1103611M11	0.1000 % JGB 0.1 12/20/30 361	48'000	0	48'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1103621M43	0.1000 % JGB 0.1 03/20/31 362	35'000	0	19'000	16'000 JPY	96.59%	106'332.22	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1103631M74	0.1000 % JGB 0.1 06/20/31 363	50'000	0	30'000	20'000 JPY	96.35%	132'593.26	0.12	a)
JP1103641MA8	0.1000 % JGB 0.1 09/20/31 364	10'000	0	0	10'000 JPY	96.19%	66'185.16	0.06	a)
JP1103671N74	0.2000 % JGB 0.2 06/20/32 367	0	38'000	38'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200621363	0.8000 % JGB 0.8 06/20/23 62	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200671434	1.9000 % JGB 1.9 03/20/24 67	5'000	0	5'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200691457	2.1000 % JGB 2.1 03/20/24 69	15'000	0	0	15'000 JPY	102.26%	105'544.66	0.10	a)
JP1200701462	2.4000 % JGB 2.4 06/20/24 70	20'000	0	0	20'000 JPY	103.20%	142'019.78	0.13	a)
JP12007314C5	2.0000 % JGB 2 12/20/24 73	0	8'000	0	8'000 JPY	103.69%	57'075.98	0.05	a)
JP1200751533	2.1000 % JGB 2.1 03/20/25 75	10'000	0	0	10'000 JPY	104.40%	71'836.95	0.07	a)
JP1200761540	1.9000 % JGB 1.9 03/20/25 76	10'000	0	0	10'000 JPY	103.99%	71'554.15	0.07	a)
JP1200841615	2.0000 % JGB 2 12/20/25 84	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1200851630	2.1000 % JGB 2.1 03/20/26 85	20'000	0	10'000	10'000 JPY	106.37%	73'192.44	0.07	a)
JP1200861647	2.3000 % JGB 2.3 03/20/26 86	5'000	0	0	5'000 JPY	106.99%	36'806.42	0.03	a)
JP1200901690	2.2000 % JGB 2.2 09/20/26 90	20'000	0	10'000	10'000 JPY	107.61%	74'042.20	0.07	a)
JP1200941746	2.1000 % JGB 2.1 03/20/27 94	20'000	0	10'000	10'000 JPY	108.03%	74'330.50	0.07	a)
JP12009817B7	2.1000 % JGB 2.1 09/20/27 98	0	6'000	0	6'000 JPY	108.69%	44'871.60	0.04	a)
JP12009917C3	2.1000 % JGB 2.1 12/20/27 99	25'000	0	0	25'000 JPY	109.09%	187'651.35	0.17	a)
JP1201001839	2.2000 % JGB 2.2 03/20/28 100	20'000	0	0	20'000 JPY	109.91%	151'249.51	0.14	a)
JP1201021860	2.4000 % JGB 2.4 06/20/28 102	20'000	0	0	20'000 JPY	111.26%	153'108.67	0.14	a)
JP1201051891	2.1000 % JGB 2.1 09/20/28 105	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201081914	1.9000 % JGB 1.9 12/20/28 108	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201091939	1.9000 % JGB 1.9 03/20/29 109	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201101944	2.1000 % JGB 2.1 03/20/29 110	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201111968	2.2000 % JGB 2.2 06/20/29 111	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201121975	2.1000 % JGB 2.1 06/20/29 112	15'000	0	0	15'000 JPY	110.77%	114'324.74	0.11	a)
JP1201131990	2.1000 % JGB 2.1 09/20/29 113	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP12011419C6	2.1000 % JGB 2.1 12/20/29 114	20'000	0	0	20'000 JPY	111.30%	153'156.83	0.14	a)
JP1201151A21	2.2000 % JGB 2.2 12/20/29 115	20'000	0	10'000	10'000 JPY	111.96%	77'034.61	0.07	a)
JP1201161A37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/30 116	10'000	0	0	10'000 JPY	112.36%	77'311.21	0.07	a)
JP1201171A43	2.1000 % JGB 2.1 03/20/30 117	20'000	0	0	20'000 JPY	111.67%	153'678.39	0.14	a)
JP1201181A66	2.0000 % JGB 2 06/20/30 118	10'000	0	0	10'000 JPY	111.15%	76'479.34	0.07	a)
JP1201191A72	1.8000 % JGB 1.8 06/20/30 119	30'000	0	30'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201201A88	1.6000 % JGB 1.6 06/20/30 120	10'000	0	0	10'000 JPY	108.24%	74'477.06	0.07	a)
JP1201221AA5	1.8000 % JGB 1.8 09/20/30 122	25'000	0	10'000	15'000 JPY	109.76%	113'281.29	0.10	a)
JP1201231AC0	2.1000 % JGB 2.1 12/20/30 123	20'000	0	10'000	10'000 JPY	112.18%	77'185.29	0.07	a)
JP1201241B22	2.0000 % JGB 2 12/20/30 124	10'000	0	0	10'000 JPY	111.43%	76'667.87	0.07	a)
JP1201251B37	2.2000 % JGB 2.2 03/20/31 125	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201261B43	2.0000 % JGB 2 03/20/31 126	15'000	0	0	15'000 JPY	111.59%	115'171.06	0.11	a)
JP1201271B58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/31 127	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201281B64	1.9000 % JGB 1.9 06/20/31 128	20'000	0	10'000	10'000 JPY	110.99%	76'367.18	0.07	a)
JP1201291B88	1.8000 % JGB 1.8 06/20/31 129	10'000	0	0	10'000 JPY	110.19%	75'819.48	0.07	a)
JP1201301B94	1.8000 % JGB 1.8 09/20/31 130	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201311BB0	1.7000 % JGB 1.7 09/20/31 131	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201321BC7	1.7000 % JGB 1.7 12/20/31 132	20'000	0	10'000	10'000 JPY	109.71%	75'489.21	0.07	a)
JP1201331C14	1.8000 % JGB 1.8 12/20/31 133	20'000	0	10'000	10'000 JPY	110.55%	76'067.87	0.07	a)
JP1201341C38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/32 134	20'000	0	10'000	10'000 JPY	110.78%	76'221.31	0.07	a)
JP1201351C43	1.7000 % JGB 1.7 03/20/32 135	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201361C58	1.6000 % JGB 1.6 03/20/32 136	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201371C64	1.7000 % JGB 1.7 06/20/32 137	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201381C70	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/32 138	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201391C86	1.6000 % JGB 1.6 06/20/32 139	10'000	0	0	10'000 JPY	109.17%	75'118.34	0.07	a)
JP1201401C92	1.7000 % JGB 1.7 09/20/32 140	30'000	0	10'000	20'000 JPY	110.19%	151'641.71	0.14	a)
JP1201411CC4	1.7000 % JGB 1.7 12/20/32 141	20'000	0	0	20'000 JPY	110.22%	151'671.98	0.14	a)
JP1201431D38	1.6000 % JGB 1.6 03/20/33 143	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201441D44	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/33 144	10'000	0	0	10'000 JPY	108.25%	74'485.32	0.07	a)
JP1201451D66	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 145	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201461D98	1.7000 % JGB 1.7 09/20/33 146	30'000	0	20'000	10'000 JPY	110.16%	75'794.02	0.07	a)
JP1201471DC6	1.6000 % JGB 1.6 12/20/33 147	20'000	0	10'000	10'000 JPY	109.08%	75'050.91	0.07	a)
JP1201481E36	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/34 148	21'000	0	10'000	11'000 JPY	108.06%	81'783.99	0.08	a)
JP1201491E67	1.5000 % JGB 1 1/2 06/20/34 149	20'000	0	10'000	10'000 JPY	107.92%	74'258.94	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1201501E99	1.4000 % JGB 1.4 09/20/34 150	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201511EC7	1.2000 % JGB 1.2 12/20/34 151	25'000	0	0	25'000 JPY	104.50%	179'754.06	0.17	a)
JP1201521F37	1.2000 % JGB 1.2 03/20/35 152	23'000	0	13'000	10'000 JPY	104.40%	71'830.75	0.07	a)
JP1201531F68	1.3000 % JGB 1.3 06/20/35 153	20'000	0	0	20'000 JPY	105.40%	145'043.15	0.13	a)
JP1201541F90	1.2000 % JGB 1.2 09/20/35 154	20'000	0	0	20'000 JPY	104.17%	143'345.00	0.13	a)
JP1201551FC0	1.0000 % JGB 1 12/20/35 155	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201561G37	0.4000 % JGB 0.4 03/20/36 156	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201571G68	0.2000 % JGB 0.2 06/20/36 157	16'000	0	0	16'000 JPY	91.32%	100'529.34	0.09	a)
JP1201581G90	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/36 158	17'000	0	17'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201591GC4	0.6000 % JGB 0.6 12/20/36 159	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201601H38	0.7000 % JGB 0.7 03/20/37 160	28'000	0	0	28'000 JPY	96.97%	186'811.57	0.17	a)
JP1201611H69	0.6000 % JGB 0.6 06/20/37 161	17'000	0	17'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201621H91	0.6000 % JGB 0.6 09/20/37 162	20'000	0	0	20'000 JPY	95.06%	130'812.55	0.12	a)
JP1201631HC6	0.6000 % JGB 0.6 12/20/37 163	20'000	0	0	20'000 JPY	94.79%	130'440.99	0.12	a)
JP1201641J38	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/38 164	20'000	0	0	20'000 JPY	93.13%	128'159.36	0.12	a)
JP1201651J76	0.5000 % JGB 0 1/2 06/20/38 165	13'000	0	0	13'000 JPY	92.74%	82'958.31	0.08	a)
JP1201661JA3	0.7000 % JGB 0.7 09/20/38 166	22'000	0	12'000	10'000 JPY	95.27%	65'554.21	0.06	a)
JP1201671K12	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/38 167	24'000	0	10'000	14'000 JPY	92.02%	88'642.30	0.08	a)
JP1201681K44	0.4000 % JGB 0.4 03/20/39 168	20'000	0	10'000	10'000 JPY	90.20%	62'061.58	0.06	a)
JP1201691K75	0.3000 % JGB 0.3 06/20/39 169	30'000	0	12'000	18'000 JPY	88.47%	109'565.72	0.10	a)
JP1201701KA5	0.3000 % JGB 0.3 09/20/39 170	25'000	0	10'000	15'000 JPY	87.97%	90'791.82	0.08	a)
JP1201711L13	0.3000 % JGB 0.3 12/20/39 171	30'000	0	20'000	10'000 JPY	87.65%	60'309.07	0.06	a)
JP1201721L45	0.4000 % JGB 0.4 03/20/40 172	26'000	0	10'000	16'000 JPY	88.88%	97'844.23	0.09	a)
JP1201731L76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/40 173	43'000	0	33'000	10'000 JPY	88.57%	60'941.41	0.06	a)
JP1201741LA9	0.4000 % JGB 0.4 09/20/40 174	40'000	0	20'000	20'000 JPY	88.20%	121'370.89	0.11	a)
JP1201751M13	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/40 175	40'000	0	20'000	20'000 JPY	89.48%	123'133.72	0.11	a)
JP1201761M45	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/41 176	45'000	0	45'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1201771M76	0.4000 % JGB 0.4 06/20/41 177	30'000	0	15'000	15'000 JPY	87.26%	90'061.09	0.08	a)
JP1201791N14	0.5000 % JGB 0 1/2 12/20/41 179	0	32'000	0	32'000 JPY	88.47%	194'803.33	0.18	a)
JP1201801N46	0.8000 % JGB 0.8 03/20/42 180	0	10'000	0	10'000 JPY	93.35%	64'227.61	0.06	a)
JP1201811N77	0.9000 % JGB 0.9 06/20/42 181	0	9'000	0	9'000 JPY	94.93%	58'787.00	0.05	a)
JP1300101357	1.1000 % JGB 1.1 03/20/33 10	10'000	0	0	10'000 JPY	104.37%	71'814.93	0.07	a)
JP1300111372	1.7000 % JGB 1.7 06/20/33 11	10'000	0	0	10'000 JPY	110.10%	75'758.24	0.07	a)
JP1300131420	2.0000 % JGB 2 12/20/33 13	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300141445	2.4000 % JGB 2.4 03/20/34 14	10'000	0	0	10'000 JPY	117.52%	80'858.19	0.07	a)
JP1300151485	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/34 15	20'000	0	10'000	10'000 JPY	118.73%	81'692.13	0.08	a)
JP13001614A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/34 16	10'000	0	0	10'000 JPY	118.90%	81'813.92	0.08	a)
JP1300171525	2.4000 % JGB 2.4 12/20/34 17	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300181540	2.3000 % JGB 2.3 03/20/35 18	10'000	0	0	10'000 JPY	117.00%	80'503.84	0.07	a)
JP1300191572	2.3000 % JGB 2.3 06/20/35 19	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP13002015A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/35 20	7'000	0	7'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300211610	2.3000 % JGB 2.3 12/20/35 21	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300221643	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/36 22	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300231675	2.5000 % JGB 2 1/2 06/20/36 23	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP13002416A5	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/36 24	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300251715	2.3000 % JGB 2.3 12/20/36 25	10'000	0	0	10'000 JPY	117.95%	81'154.75	0.07	a)
JP1300261748	2.4000 % JGB 2.4 03/20/37 26	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP13002717A6	2.5000 % JGB 2 1/2 09/20/37 27	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300281845	2.5000 % JGB 2 1/2 03/20/38 28	24'000	0	10'000	14'000 JPY	121.10%	116'652.95	0.11	a)
JP13002918A0	2.4000 % JGB 2.4 09/20/38 29	30'000	0	13'000	17'000 JPY	119.76%	140'079.09	0.13	a)
JP1300301940	2.3000 % JGB 2.3 03/20/39 30	25'000	0	10'000	15'000 JPY	118.30%	122'096.46	0.11	a)
JP13003119A4	2.2000 % JGB 2.2 09/20/39 31	20'000	0	10'000	10'000 JPY	116.93%	80'452.92	0.07	a)
JP1300321A34	2.3000 % JGB 2.3 03/20/40 32	35'000	0	20'000	15'000 JPY	118.52%	122'327.65	0.11	a)
JP1300331A99	2.0000 % JGB 2 09/20/40 33	35'000	0	15'000	20'000 JPY	113.73%	156'510.47	0.14	a)
JP1300341B39	2.2000 % JGB 2.2 03/20/41 34	30'000	0	0	30'000 JPY	116.96%	241'431.01	0.22	a)
JP1300351B93	2.0000 % JGB 2 09/20/41 35	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300361C33	2.0000 % JGB 2 03/20/42 36	55'000	0	7'000	48'000 JPY	113.88%	376'127.15	0.35	a)
JP1300371C98	1.9000 % JGB 1.9 09/20/42 37	45'000	0	20'000	25'000 JPY	112.19%	192'978.71	0.18	a)
JP1300381D38	1.8000 % JGB 1.8 03/20/43 38	20'000	0	0	20'000 JPY	110.34%	151'844.00	0.14	a)
JP1300391D69	1.9000 % JGB 1.9 06/20/43 39	18'000	0	0	18'000 JPY	112.19%	138'953.34	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP1300401D91	1.8000 % JGB 1.8 09/20/43 40	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300411DC2	1.7000 % JGB 1.7 12/20/43 41	30'000	0	14'000	16'000 JPY	108.57%	119'519.99	0.11 a)	
JP1300421E39	1.7000 % JGB 1.7 03/20/44 42	10'000	0	0	10'000 JPY	108.48%	74'640.13	0.07 a)	
JP1300431E60	1.7000 % JGB 1.7 06/20/44 43	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300451EC6	1.5000 % JGB 1 1/2 12/20/44 45	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300461F39	1.5000 % JGB 1 1/2 03/20/45 46	20'000	0	0	20'000 JPY	104.63%	143'990.40	0.13 a)	
JP1300481F92	1.4000 % JGB 1.4 09/20/45 48	10'000	0	0	10'000 JPY	102.53%	70'546.13	0.07 a)	
JP1300491FC9	1.4000 % JGB 1.4 12/20/45 49	10'000	0	0	10'000 JPY	102.47%	70'508.29	0.07 a)	
JP1300501G30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/46 50	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300511G61	0.3000 % JGB 0.3 06/20/46 51	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300521G93	0.5000 % JGB 0 1/2 09/20/46 52	20'000	0	0	20'000 JPY	83.79%	115'304.89	0.11 a)	
JP1300531GC0	0.6000 % JGB 0.6 12/20/46 53	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300541H31	0.8000 % JGB 0.8 03/20/47 54	10'000	0	0	10'000 JPY	89.42%	61'527.64	0.06 a)	
JP1300551H61	0.8000 % JGB 0.8 06/20/47 55	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300561H93	0.8000 % JGB 0.8 09/20/47 56	20'000	0	20'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300571HC4	0.8000 % JGB 0.8 12/20/47 57	10'000	0	0	10'000 JPY	88.72%	61'045.99	0.06 a)	
JP1300581J30	0.8000 % JGB 0.8 03/20/48 58	20'000	0	0	20'000 JPY	88.49%	121'767.22	0.11 a)	
JP1300591J79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/48 59	25'000	0	10'000	15'000 JPY	86.15%	88'917.52	0.08 a)	
JP1300601JA9	0.9000 % JGB 0.9 09/20/48 60	10'000	0	0	10'000 JPY	90.22%	62'073.96	0.06 a)	
JP1300611K15	0.7000 % JGB 0.7 12/20/48 61	21'000	0	10'000	11'000 JPY	85.58%	64'770.22	0.06 a)	
JP1300621K47	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/49 62	22'000	0	22'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300631K78	0.4000 % JGB 0.4 06/20/49 63	20'000	0	10'000	10'000 JPY	78.52%	54'024.96	0.05 a)	
JP1300641KA3	0.4000 % JGB 0.4 09/20/49 64	25'000	0	10'000	15'000 JPY	78.24%	80'747.41	0.07 a)	
JP1300651L15	0.4000 % JGB 0.4 12/20/49 65	22'000	0	10'000	12'000 JPY	78.10%	64'488.12	0.06 a)	
JP1300661L47	0.4000 % JGB 0.4 03/20/50 66	20'000	0	10'000	10'000 JPY	77.75%	53'497.21	0.05 a)	
JP1300671L78	0.6000 % JGB 0.6 06/20/50 67	30'000	0	20'000	10'000 JPY	81.99%	56'412.55	0.05 a)	
JP1300681LA7	0.6000 % JGB 0.6 09/20/50 68	40'000	0	23'000	17'000 JPY	81.80%	95'687.28	0.09 a)	
JP1300691M16	0.7000 % JGB 0.7 12/20/50 69	25'000	0	0	25'000 JPY	84.06%	144'592.12	0.13 a)	
JP1300701M48	0.7000 % JGB 0.7 03/20/51 70	30'000	0	20'000	10'000 JPY	83.89%	57'720.56	0.05 a)	
JP1300711M79	0.7000 % JGB 0.7 06/20/51 71	30'000	0	10'000	20'000 JPY	83.63%	115'091.59	0.11 a)	
JP1300721MA9	0.7000 % JGB 0.7 09/20/51 72	25'000	0	25'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1300741N49	1.0000 % JGB 1 03/20/52 74	0	15'000	0	15'000 JPY	90.78%	93'696.15	0.09 a)	
JP1300751N79	1.3000 % JGB 1.3 06/20/52 75	0	18'000	0	18'000 JPY	98.02%	121'398.55	0.11 a)	
JP1300761NA3	1.4000 % JGB 1.4 09/20/52 76	0	10'000	0	10'000 JPY	100.43%	69'103.26	0.06 a)	
JP14000117B7	2.4000 % JGB 2.4 03/20/48 1	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1400021950	2.2000 % JGB 2.2 03/20/49 2	11'000	0	0	11'000 JPY	118.43%	89'635.04	0.08 a)	
JP1400031A58	2.2000 % JGB 2.2 03/20/50 3	10'000	0	0	10'000 JPY	118.55%	81'571.03	0.08 a)	
JP1400041B55	2.2000 % JGB 2.2 03/20/51 4	20'000	0	10'000	10'000 JPY	118.89%	81'803.60	0.08 a)	
JP1400051C51	2.0000 % JGB 2 03/20/52 5	20'000	0	0	20'000 JPY	114.86%	158'058.62	0.15 a)	
JP1400061D58	1.9000 % JGB 1.9 03/20/53 6	12'000	0	4'000	8'000 JPY	112.41%	61'875.94	0.06 a)	
JP1400071E55	1.7000 % JGB 1.7 03/20/54 7	10'000	0	0	10'000 JPY	107.55%	74'000.92	0.07 a)	
JP1400081F45	1.4000 % JGB 1.4 03/20/55 8	17'000	0	17'000	0 JPY	0.00%	0.00	0.00	
JP1400091G59	0.4000 % JGB 0.4 03/20/56 9	34'000	0	20'000	14'000 JPY	73.38%	70'685.54	0.07 a)	
JP1400101H56	0.9000 % JGB 0.9 03/20/57 10	10'000	0	0	10'000 JPY	86.49%	59'510.23	0.05 a)	
JP1400111J52	0.8000 % JGB 0.8 03/20/58 11	20'000	0	10'000	10'000 JPY	83.42%	57'399.93	0.05 a)	
JP1400121K57	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/59 12	30'000	0	10'000	20'000 JPY	74.64%	102'709.14	0.09 a)	
JP1400131L54	0.5000 % JGB 0 1/2 03/20/60 13	35'000	0	18'000	17'000 JPY	74.43%	87'057.13	0.08 a)	
JP1400141M51	0.7000 % JGB 0.7 03/20/61 14	30'000	0	10'000	20'000 JPY	79.74%	109'727.42	0.10 a)	
JP1400151N57	1.0000 % JGB 1 03/20/62 15	0	12'000	0	12'000 JPY	86.99%	71'829.24	0.07 a)	
JPY							14'959'054.24	13.79	
US912810EQ77	6.2500 % T 6 1/4 08/15/23	77	0	77	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810EW46	6.0000 % T 6 02/15/26	98	0	0	98 USD	103.91%	95'438.41	0.09 a)	
US912810FB99	6.1250 % T 6 1/8 11/15/27	130	0	130	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810FF04	5.2500 % T 5 1/4 11/15/28	105	0	105	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810FM54	6.2500 % T 6 1/4 05/15/30	104	0	0	104 USD	113.50%	110'632.99	0.10 a)	
US912810FP85	5.3750 % T 5 3/8 02/15/31	117	0	117	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810FT08	4.5000 % T 4 1/2 02/15/36	67	0	67	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810PU60	5.0000 % T 5 05/15/37	73	0	73	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810PW27	4.3750 % T 4 3/8 02/15/38	122	0	122	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810PX00	4.5000 % T 4 1/2 05/15/38	88	0	88	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810QA97	3.5000 % T 3 1/2 02/15/39	83	0	83	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QB70	4.2500 % T 4 1/4 05/15/39	154	0	0	154 USD	102.95%	148'598.93	0.14 a)	
US912810QC53	4.5000 % T 4 1/2 08/15/39	110	0	0	110 USD	106.00%	109'283.35	0.10 a)	
US912810QD37	4.3750 % T 4 3/8 11/15/39	180	0	100	80 USD	104.48%	78'342.38	0.07 a)	
US912810QE10	4.6250 % T 4 5/8 02/15/40	128	0	128	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QH41	4.3750 % T 4 3/8 05/15/40	184	0	80	104 USD	104.19%	101'555.72	0.09 a)	
US912810QK79	3.8750 % T 3 7/8 08/15/40	141	0	141	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QL52	4.2500 % T 4 1/4 11/15/40	135	0	0	135 USD	102.72%	129'968.75	0.12 a)	
US912810QN19	4.7500 % T 4 3/4 02/15/41	173	0	100	73 USD	109.22%	74'726.65	0.07 a)	
US912810QQ40	4.3750 % T 4 3/8 05/15/41	147	0	0	147 USD	104.30%	143'695.81	0.13 a)	
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	169	0	0	169 USD	95.88%	151'861.45	0.14 a)	
US912810QT88	3.1250 % T 3 1/8 11/15/41	120	0	120	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QU51	3.1250 % T 3 1/8 02/15/42	186	0	0	186 USD	86.94%	151'556.84	0.14 a)	
US912810QW18	3.0000 % T 3 05/15/42	158	101	158	101 USD	85.00%	80'462.91	0.07 a)	
US912810QX90	2.7500 % T 2 3/4 08/15/42	175	0	175	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810QY73	2.7500 % T 2 3/4 11/15/42	243	0	0	243 USD	81.20%	184'941.53	0.17 a)	
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	265	0	100	165 USD	86.13%	133'189.08	0.12 a)	
US912810RB61	2.8750 % T 2 7/8 05/15/43	291	0	191	100 USD	82.66%	77'469.57	0.07 a)	
US912810RC45	3.6250 % T 3 5/8 08/15/43	214	0	100	114 USD	93.03%	99'400.64	0.09 a)	
US912810RD28	3.7500 % T 3 3/4 11/15/43	219	0	100	119 USD	94.67%	105'590.15	0.10 a)	
US912810RE01	3.6250 % T 3 5/8 02/15/44	282	0	140	142 USD	92.75%	123'440.51	0.11 a)	
US912810RG58	3.3750 % T 3 3/8 05/15/44	172	0	50	122 USD	89.17%	101'963.14	0.09 a)	
US912810RH32	3.1250 % T 3 1/8 08/15/44	308	0	120	188 USD	85.50%	150'653.57	0.14 a)	
US912810RJ97	3.0000 % T 3 11/15/44	205	0	0	205 USD	83.64%	160'703.95	0.15 a)	
US912810RK60	2.5000 % T 2 1/2 02/15/45	341	0	220	121 USD	76.38%	86'614.79	0.08 a)	
US912810RM27	3.0000 % T 3 05/15/45	142	0	142	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RN00	2.8750 % T 2 7/8 08/15/45	225	0	0	225 USD	81.53%	171'934.12	0.16 a)	
US912810RP57	3.0000 % T 3 11/15/45	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RQ31	2.5000 % T 2 1/2 02/15/46	261	0	261	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RS96	2.5000 % T 2 1/2 05/15/46	260	0	120	140 USD	75.97%	99'682.40	0.09 a)	
US912810RT79	2.2500 % T 2 1/4 08/15/46	340	0	0	340 USD	72.13%	229'837.13	0.21 a)	
US912810RU43	2.8750 % T 2 7/8 11/15/46	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RV26	3.0000 % T 3 02/15/47	315	0	315	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810RX81	3.0000 % T 3 05/15/47	200	0	0	200 USD	83.28%	156'110.70	0.14 a)	
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	320	0	200	120 USD	79.50%	89'413.65	0.08 a)	
US912810RZ30	2.7500 % T 2 3/4 11/15/47	342	0	342	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SA79	3.0000 % T 3 02/15/48	355	0	0	355 USD	83.36%	277'356.46	0.26 a)	
US912810SC36	3.1250 % T 3 1/8 05/15/48	400	0	140	260 USD	85.38%	208'046.07	0.19 a)	
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	450	0	350	100 USD	83.45%	78'216.44	0.07 a)	
US912810SE91	3.3750 % T 3 3/8 11/15/48	426	0	120	306 USD	89.47%	256'595.04	0.24 a)	
US912810SF66	3.0000 % T 3 02/15/49	490	0	200	290 USD	83.66%	227'379.78	0.21 a)	
US912810SH23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/49	437	0	250	187 USD	81.73%	143'252.37	0.13 a)	
US912810SJ88	2.2500 % T 2 1/4 08/15/49	430	0	200	230 USD	71.72%	154'602.32	0.14 a)	
US912810SK51	2.3750 % T 2 3/8 11/15/49	520	0	250	270 USD	73.77%	186'669.43	0.17 a)	
US912810SL35	2.0000 % T 2 02/15/50	600	0	300	300 USD	67.63%	190'144.59	0.18 a)	
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	520	0	300	220 USD	55.48%	114'406.02	0.11 a)	
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	750	0	350	400 USD	57.34%	214'981.72	0.20 a)	
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	700	0	550	150 USD	62.92%	88'460.30	0.08 a)	
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	330	0	0	330 USD	63.27%	195'675.82	0.18 a)	
US912810SS87	1.6250 % T 1 5/8 11/15/50	650	100	650	100 USD	61.28%	57'435.85	0.05 a)	
US912810ST60	1.3750 % T 1 3/8 11/15/40	750	0	500	250 USD	65.64%	153'804.18	0.14 a)	
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	770	0	220	550 USD	65.31%	336'677.77	0.31 a)	
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	500	0	0	500 USD	71.41%	334'627.54	0.31 a)	
US912810SX72	2.3750 % T 2 3/8 05/15/51	700	0	250	450 USD	73.44%	309'731.84	0.29 a)	
US912810SY55	2.2500 % T 2 1/4 05/15/41	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	750	0	450	300 USD	67.23%	189'046.27	0.17 a)	
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	644	0	250	394 USD	69.25%	255'723.98	0.24 a)	
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	510	0	0	510 USD	65.06%	310'997.12	0.29 a)	
US912810TC27	2.0000 % T 2 11/15/41	150	0	0	150 USD	72.19%	101'486.60	0.09 a)	
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	0	250	0	250 USD	71.33%	167'130.70	0.15 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912810TF57	2.3750 % T 2 3/8 02/15/42	0	312	0	312 USD	76.91%	224'890.79	0.21	a)
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	0	415	150	265 USD	81.91%	203'431.57	0.19	a)
US912810TH14	3.2500 % T 3 1/4 05/15/42	0	345	100	245 USD	88.36%	202'896.33	0.19	a)
US912810TJ79	3.0000 % T 3 08/15/52	0	299	0	299 USD	84.13%	235'750.01	0.22	a)
US912810TK43	3.3750 % T 3 3/8 08/15/42	0	100	0	100 USD	90.00%	84'352.50	0.08	a)
US912810TL26	4.0000 % T 4 11/15/52	0	250	0	250 USD	101.75%	238'412.97	0.22	a)
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	740	0	350	390 USD	90.75%	331'716.21	0.31	a)
US9128282D10	1.3750 % T 1 3/8 08/31/23	360	0	360	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282N91	2.1250 % T 2 1/8 07/31/24	360	0	300	60 USD	95.97%	53'968.03	0.05	a)
US9128282R06	2.2500 % T 2 1/4 08/15/27	600	300	600	300 USD	91.91%	258'417.40	0.24	a)
US9128282U35	1.8750 % T 1 7/8 08/31/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128282Y56	2.1250 % T 2 1/8 09/30/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283D01	2.2500 % T 2 1/4 10/31/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283F58	2.2500 % T 2 1/4 11/15/27	550	0	250	300 USD	91.63%	257'626.59	0.24	a)
US9128283J70	2.1250 % T 2 1/8 11/30/24	300	0	200	100 USD	95.34%	89'360.93	0.08	a)
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	250	0	0	250 USD	95.41%	223'548.77	0.21	a)
US9128283U26	2.3750 % T 2 3/8 01/31/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	200	0	0	200 USD	95.77%	179'512.65	0.17	a)
US9128283W81	2.7500 % T 2 3/4 02/15/28	650	0	200	450 USD	93.55%	394'545.66	0.36	a)
US9128283Z13	2.7500 % T 2 3/4 02/28/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284A52	2.6250 % T 2 5/8 02/28/23	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284D91	2.5000 % T 2 1/2 03/31/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284F40	2.6250 % T 2 5/8 03/31/25	300	0	0	300 USD	95.81%	269'400.80	0.25	a)
US9128284L18	2.7500 % T 2 3/4 04/30/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284M90	2.8750 % T 2 7/8 04/30/25	250	0	0	250 USD	96.16%	225'306.12	0.21	a)
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	800	0	410	390 USD	93.88%	343'138.94	0.32	a)
US9128284R87	2.8750 % T 2 7/8 05/31/25	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284S60	2.7500 % T 2 3/4 05/31/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284U17	2.6250 % T 2 5/8 06/30/23	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	720	0	450	270 USD	93.69%	237'083.25	0.22	a)
US9128284X55	2.7500 % T 2 3/4 08/31/23	360	0	360	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128284Z04	2.7500 % T 2 3/4 08/31/25	260	0	260	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285C00	3.0000 % T 3 09/30/25	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285D82	2.8750 % T 2 7/8 09/30/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285J52	3.0000 % T 3 10/31/25	360	0	360	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285K26	2.8750 % T 2 7/8 10/31/23	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	650	50	350	350 USD	94.77%	310'866.77	0.29	a)
US9128285N64	2.8750 % T 2 7/8 11/30/25	160	0	0	160 USD	95.72%	143'539.84	0.13	a)
US9128285P13	2.8750 % T 2 7/8 11/30/23	370	0	370	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285T35	2.6250 % T 2 5/8 12/31/25	400	0	250	150 USD	95.06%	133'645.99	0.12	a)
US9128285U08	2.6250 % T 2 5/8 12/31/23	440	0	440	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	440	0	0	440 USD	97.64%	402'660.15	0.37	a)
US9128286A35	2.6250 % T 2 5/8 01/31/26	240	0	0	240 USD	94.94%	213'552.41	0.20	a)
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	630	0	200	430 USD	92.05%	370'965.03	0.34	a)
US9128286F22	2.5000 % T 2 1/2 02/28/26	250	0	0	250 USD	94.50%	221'425.31	0.20	a)
US9128286G05	2.3750 % T 2 3/8 02/29/24	300	0	0	300 USD	97.30%	273'574.50	0.25	a)
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	330	0	230	100 USD	93.72%	87'837.90	0.08	a)
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	300	0	0	300 USD	96.75%	272'036.81	0.25	a)
US9128286S43	2.3750 % T 2 3/8 04/30/26	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	540	0	200	340 USD	90.47%	288'292.24	0.27	a)
US9128286X38	2.1250 % T 2 1/8 05/31/26	270	0	0	270 USD	93.05%	235'462.11	0.22	a)
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	250	0	0	250 USD	95.70%	224'244.37	0.21	a)
US9128287B09	1.8750 % T 1 7/8 06/30/26	250	0	0	250 USD	92.27%	216'189.88	0.20	a)
US9128288B67	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	583	0	0	583 USD	97.75%	534'122.37	0.49	a)
US9128288D564	2.3750 % T 2 3/8 08/15/24	655	0	400	255 USD	96.20%	229'924.26	0.21	a)
US9128288G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	751	0	350	401 USD	95.64%	359'453.08	0.33	a)
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	758	0	350	408 USD	94.77%	362'381.84	0.33	a)
US912828K742	2.0000 % T 2 08/15/25	629	195	400	424 USD	93.94%	373'301.99	0.34	a)
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	810	0	400	410 USD	94.16%	361'816.58	0.33	a)
US912828P386	1.7500 % T 1 3/4 01/31/23	330	0	330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	630	0	250	380 USD	92.09%	327'996.50	0.30	a)
US912828P790	1.5000 % T 1 1/2 02/28/23	330	0	330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Q293	1.5000 % T 1 1/2 03/31/23	320	0	320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828R283	1.6250 % T 1 5/8 04/30/23	360	0	360	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828R366	1.6250 % T 1 5/8 05/15/26	590	100	590	100 USD	91.59%	85'846.24	0.08	a)
US912828R697	1.6250 % T 1 5/8 05/31/23	360	0	360	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828S356	1.3750 % T 1 3/8 06/30/23	295	0	295	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828S927	1.2500 % T 1 1/4 07/31/23	360	0	360	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828T263	1.3750 % T 1 3/8 09/30/23	280	0	280	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828T917	1.6250 % T 1 5/8 10/31/23	320	0	320	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	640	0	300	340 USD	91.94%	292'972.63	0.27	a)
US912828U576	2.1250 % T 2 1/8 11/30/23	260	0	260	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828UN88	2.0000 % T 2 02/15/23	548	0	548	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V236	2.2500 % T 2 1/4 12/31/23	240	0	0	240 USD	97.69%	219'738.26	0.20	a)
US912828V806	2.2500 % T 2 1/4 01/31/24	300	0	0	300 USD	97.42%	273'925.97	0.25	a)
US912828V988	2.2500 % T 2 1/4 02/15/27	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828VB32	1.7500 % T 1 3/4 05/15/23	645	0	645	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828V566	2.5000 % T 2 1/2 08/15/23	477	0	477	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828W481	2.1250 % T 2 1/8 02/29/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	635	0	400	235 USD	96.80%	213'198.76	0.20	a)
US912828WE61	2.7500 % T 2 3/4 11/15/23	680	0	680	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	766	0	600	166 USD	96.92%	150'794.45	0.14	a)
US912828X703	2.0000 % T 2 04/30/24	300	0	0	300 USD	96.45%	271'202.06	0.25	a)
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	660	116	400	376 USD	92.66%	326'526.18	0.30	a)
US912828XB14	2.1250 % T 2 1/8 05/15/25	863	380	863	380 USD	94.58%	336'844.71	0.31	a)
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	525	0	0	525 USD	96.22%	473'450.38	0.44	a)
US912828XX34	2.0000 % T 2 06/30/24	350	0	250	100 USD	95.97%	89'946.71	0.08	a)
US912828XZ81	2.7500 % T 2 3/4 06/30/25	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y610	2.7500 % T 2 3/4 07/31/23	285	0	285	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Y792	2.8750 % T 2 7/8 07/31/25	200	86	200	86 USD	96.00%	77'379.36	0.07	a)
US912828Y875	1.7500 % T 1 3/4 07/31/24	300	0	0	300 USD	95.44%	268'346.39	0.25	a)
US912828Y958	1.8750 % T 1 7/8 07/31/26	300	0	150	150 USD	92.06%	129'428.37	0.12	a)
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	400	0	0	400 USD	86.42%	323'995.63	0.30	a)
US912828YD60	1.3750 % T 1 3/8 08/31/26	500	0	350	150 USD	90.28%	126'924.16	0.12	a)
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	300	0	0	300 USD	94.52%	265'754.29	0.25	a)
US912828YG91	1.6250 % T 1 5/8 09/30/26	300	0	200	100 USD	90.97%	85'260.46	0.08	a)
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	400	0	0	400 USD	94.70%	355'042.00	0.33	a)
US912828YM69	1.5000 % T 1 1/2 10/31/24	250	0	0	250 USD	94.50%	221'425.31	0.20	a)
US912828YQ73	1.6250 % T 1 5/8 10/31/26	130	0	0	130 USD	90.78%	110'610.15	0.10	a)
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	350	0	0	350 USD	87.00%	285'392.63	0.26	a)
US912828YU85	1.6250 % T 1 5/8 11/30/26	150	0	0	150 USD	90.69%	127'495.29	0.12	a)
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	500	0	0	500 USD	94.31%	441'971.95	0.41	a)
US912828YX25	1.7500 % T 1 3/4 12/31/26	300	0	0	300 USD	91.03%	255'957.12	0.24	a)
US912828YY08	1.7500 % T 1 3/4 12/31/24	400	0	200	200 USD	94.56%	177'257.41	0.16	a)
US912828Z294	1.5000 % T 1 1/2 01/15/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z526	1.3750 % T 1 3/8 01/31/25	300	0	200	100 USD	93.73%	87'852.55	0.08	a)
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	230	0	0	230 USD	89.86%	193'707.62	0.18	a)
US912828Z864	1.3750 % T 1 3/8 02/15/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828Z948	1.5000 % T 1 1/2 02/15/30	650	0	250	400 USD	84.89%	318'254.93	0.29	a)
US912828ZB95	1.1250 % T 1 1/8 02/28/27	200	0	0	200 USD	88.50%	165'893.25	0.15	a)
US912828ZC78	1.1250 % T 1 1/8 02/28/25	500	0	0	500 USD	93.03%	435'967.70	0.40	a)
US912828ZD51	0.5000 % T 0 1/2 03/15/23	250	0	250	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZE35	0.6250 % T 0 5/8 03/31/27	350	0	0	350 USD	86.41%	283'444.91	0.26	a)
US912828ZH65	0.2500 % T 0 1/4 04/15/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	150	200	0	350 USD	91.09%	298'821.66	0.28	a)
US912828ZN34	0.5000 % T 0 1/2 04/30/27	150	0	150	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZP81	0.1250 % T 0 1/8 05/15/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	880	0	500	380 USD	79.06%	281'585.05	0.26	a)
US912828ZS21	0.5000 % T 0 1/2 05/31/27	380	0	100	280 USD	85.44%	224'213.63	0.21	a)
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	500	0	250	250 USD	90.58%	212'235.86	0.20	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US912828ZU76	0.2500 % T 0 1/4 06/15/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZV59	0.5000 % T 0 1/2 06/30/27	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US912828ZW33	0.2500 % T 0 1/4 06/30/25	450	0	0	450 USD	90.38%	381'167.86	0.35	a)
US912828ZY98	0.1250 % T 0 1/8 07/15/23	200	0	200	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	450	0	0	450 USD	90.08%	379'915.73	0.35	a)
US91282CAD39	0.3750 % T 0 3/8 07/31/27	440	0	150	290 USD	84.53%	229'758.06	0.21	a)
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	1'100	0	800	300 USD	78.63%	221'073.84	0.20	a)
US91282CAF86	0.1250 % T 0 1/8 08/15/23	330	0	330	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAH43	0.5000 % T 0 1/2 08/31/27	500	137	350	287 USD	84.80%	228'095.77	0.21	a)
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	500	0	300	200 USD	89.81%	168'353.53	0.16	a)
US91282CAK71	0.1250 % T 0 1/8 09/15/23	220	0	220	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	450	0	0	450 USD	84.08%	354'609.98	0.33	a)
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	500	0	0	500 USD	89.64%	420'078.36	0.39	a)
US91282CAP68	0.1250 % T 0 1/8 10/15/23	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAT80	0.2500 % T 0 1/4 10/31/25	500	0	0	500 USD	89.28%	418'394.26	0.39	a)
US91282CAU53	0.5000 % T 0 1/2 10/31/27	300	100	0	400 USD	84.38%	316'321.88	0.29	a)
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	1'000	0	250	750 USD	79.91%	561'691.00	0.52	a)
US91282CAW10	0.2500 % T 0 1/4 11/15/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	600	0	0	600 USD	84.72%	476'415.89	0.44	a)
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	300	0	0	300 USD	89.33%	251'168.34	0.23	a)
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	500	0	300	200 USD	96.19%	180'303.47	0.17	a)
US91282CBB63	0.6250 % T 0 5/8 12/31/27	584	0	180	404 USD	84.53%	320'076.73	0.30	a)
US91282CBC47	0.3750 % T 0 3/8 12/31/25	550	100	400	250 USD	89.20%	209'014.06	0.19	a)
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	300	0	0	300 USD	88.83%	249'762.47	0.23	a)
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	635	0	480	155 USD	84.86%	123'278.40	0.11	a)
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	1'200	0	650	550 USD	81.36%	419'397.43	0.39	a)
US91282CBM29	0.1250 % T 0 1/8 02/15/24	400	0	400	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	622	0	522	100 USD	86.31%	80'896.39	0.07	a)
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	612	0	400	212 USD	88.89%	176'622.99	0.16	a)
US91282CBR16	0.2500 % T 0 1/4 03/15/24	300	0	300	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CBS98	1.2500 % T 1 1/4 03/31/28	586	0	0	586 USD	86.69%	476'112.46	0.44	a)
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	612	0	300	312 USD	89.47%	261'626.31	0.24	a)
US91282CBV28	0.3750 % T 0 3/8 04/15/24	300	0	0	300 USD	94.84%	266'676.91	0.25	a)
US91282CBW01	0.7500 % T 0 3/4 04/30/26	350	0	0	350 USD	89.14%	292'414.66	0.27	a)
US91282CBZ32	1.2500 % T 1 1/4 04/30/28	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	1'100	0	500	600 USD	84.06%	472'725.47	0.44	a)
US91282CCC38	0.2500 % T 0 1/4 05/15/24	550	0	0	550 USD	94.31%	486'169.15	0.45	a)
US91282CCD11	0.1250 % T 0 1/8 05/31/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	600	0	230	370 USD	86.36%	299'479.22	0.28	a)
US91282CCF68	0.7500 % T 0 3/4 05/31/26	500	0	200	300 USD	88.91%	249'982.15	0.23	a)
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	400	0	0	400 USD	93.95%	352'230.25	0.32	a)
US91282CCH25	1.2500 % T 1 1/4 06/30/28	600	0	300	300 USD	86.17%	242'293.78	0.22	a)
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	600	0	250	350 USD	89.13%	292'363.42	0.27	a)
US91282CCK53	0.1250 % T 0 1/8 06/30/23	820	0	820	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCL37	0.3750 % T 0 3/8 07/15/24	250	0	0	250 USD	93.77%	219'704.57	0.20	a)
US91282CCN92	0.1250 % T 0 1/8 07/31/23	450	0	450	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	450	0	350	100 USD	88.09%	82'565.87	0.08	a)
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	600	0	400	200 USD	84.81%	158'981.03	0.15	a)
US91282CCS89	1.2500 % T 1 1/4 08/15/31	1'130	0	700	430 USD	81.06%	326'696.06	0.30	a)
US91282CCT62	0.3750 % T 0 3/8 08/15/24	600	0	300	300 USD	93.45%	262'766.81	0.24	a)
US91282CCU36	0.1250 % T 0 1/8 08/31/23	600	0	600	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	620	0	300	320 USD	85.23%	255'634.96	0.24	a)
US91282CCW91	0.7500 % T 0 3/4 08/31/26	300	0	0	300 USD	88.25%	248'136.94	0.23	a)
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	450	0	0	450 USD	93.17%	392'964.05	0.36	a)
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	550	0	270	280 USD	85.64%	224'746.68	0.21	a)
US91282CCZ23	0.8750 % T 0 7/8 09/30/26	500	0	200	300 USD	88.45%	248'708.06	0.23	a)
US91282CDA62	0.2500 % T 0 1/4 09/30/23	500	0	500	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDB46	0.6250 % T 0 5/8 10/15/24	500	0	0	500 USD	93.25%	436'992.81	0.40	a)
US91282CDD02	0.3750 % T 0 3/8 10/31/23	650	0	650	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	400	0	0	400 USD	86.09%	322'765.47	0.30	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 28.02.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US91282CDG33	1.1250 % T 1 1/8 10/31/26	550	0	300	250 USD	89.06%	208'684.57	0.19	a)
US91282CDH16	0.7500 % T 0 3/4 11/15/24	0	411	0	411 USD	93.17%	358'907.17	0.33	a)
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	600	205	240	565 USD	81.39%	431'000.97	0.40	a)
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	650	0	0	650 USD	89.31%	544'102.91	0.50	a)
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	200	200	0	400 USD	86.59%	324'639.97	0.30	a)
US91282CDM01	0.5000 % T 0 1/2 11/30/23	350	0	350	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	0	174	0	174 USD	93.33%	152'200.90	0.14	a)
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	0	470	300	170 USD	85.91%	136'876.58	0.13	a)
US91282CDS70	1.1250 % T 1 1/8 01/15/25	0	200	0	200 USD	93.36%	175'002.16	0.16	a)
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	0	938	300	638 USD	84.72%	506'588.90	0.47	a)
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	0	350	0	350 USD	90.63%	297'283.98	0.27	a)
US91282CEM91	2.8750 % T 2 7/8 04/30/29	0	330	0	330 USD	93.22%	288'318.61	0.27	a)
US91282CEN74	2.7500 % T 2 3/4 04/30/27	0	370	0	370 USD	94.11%	326'354.86	0.30	a)
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	0	686	300	386 USD	91.98%	332'779.71	0.31	a)
US91282CE561	2.7500 % T 2 3/4 05/31/29	0	322	322	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CET45	2.6250 % T 2 5/8 05/31/27	0	230	0	230 USD	93.58%	201'724.02	0.19	a)
US91282CEV90	3.2500 % T 3 1/4 06/30/29	0	307	0	307 USD	95.16%	273'798.55	0.25	a)
US91282CEW73	3.2500 % T 3 1/4 06/30/27	0	360	0	360 USD	95.95%	323'755.42	0.30	a)
US91282CEX56	3.0000 % T 3 06/30/24	0	201	0	201 USD	97.28%	183'265.47	0.17	a)
US91282CFB28	2.7500 % T 2 3/4 07/31/27	0	377	0	377 USD	93.94%	331'921.82	0.31	a)
US91282CFC01	2.6250 % T 2 5/8 07/31/29	0	267	167	100 USD	91.69%	85'934.11	0.08	a)
US91282CFE66	3.1250 % T 3 1/8 08/15/25	0	322	0	322 USD	96.53%	291'326.01	0.27	a)
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	0	500	0	500 USD	90.88%	425'862.97	0.39	a)
US91282CFH97	3.1250 % T 3 1/8 08/31/27	0	345	345	0 USD	0.00%	0.00	0.00	
US91282CFL00	3.8750 % T 3 7/8 09/30/29	0	240	0	240 USD	98.66%	221'917.37	0.20	a)
US91282CFT36	4.0000 % T 4 10/31/29	0	200	0	200 USD	99.41%	186'337.02	0.17	a)
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	0	500	0	500 USD	101.61%	476'166.96	0.44	a)
USD							46'508'715.35	42.89	

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

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							46'308'741.29	42.70
CH0302469082	SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVT. ST	41	3	22	23 AUD	103'053.02	1'488'030.07	1.37 a)
AUD							1'488'030.07	1.37
CH0302468589	SWC (CH) INDEX BF CANADA GOVT. ST	51	3	25	29 CAD	97'185.80	1'926'052.28	1.78 a)
CAD							1'926'052.28	1.78
CH0302469108	SWC (CH) INDEX BF WORLD REST GOVT. ST CHF	74	3	39	38 CHF	88'116.36	3'364'370.58	3.10 a)
CHF							3'364'370.58	3.10
CH1127485220	SWC (CH) INDEX BF CHINA GOVT. NT	15'138	27'168	13'199	29'108 CNY	1'048.33	4'114'061.20	3.79 a)
CNY							4'114'061.20	3.79
CH0302432049	SWC (CH) INDEX BF AUSTRIA GOVT. ST EUR	25	0	12	13 EUR	82'610.23	1'081'564.31	1.00 a)
CH0302432064	SWC (CH) INDEX BF BELGIUM GOVT. ST EUR	40	1	20	21 EUR	84'151.66	1'723'128.87	1.59 a)
CH0302432072	SWC (CH) INDEX BF FINLAND GOVT. ST EUR	11	0	5	6 EUR	83'551.84	473'615.81	0.44 a)
CH0302432098	SWC (CH) INDEX BF FRANCE GOVT. ST EUR	178	13	99	93 EUR	85'817.67	7'897'741.51	7.28 a)
CH0302432130	SWC (CH) INDEX BF GERMANY GOVT. ST EUR	131	8	68	71 EUR	85'475.52	6'045'245.72	5.57 a)
CH0302432148	SWC (CH) INDEX BF IRELAND GOVT. ST EUR	14	0	8	7 EUR	86'083.59	595'605.64	0.55 a)
CH0302432163	SWC (CH) INDEX BF ITALY GOVT. ST EUR	151	11	85	77 EUR	91'650.10	7'023'234.81	6.48 a)
CH0302432171	SWC (CH) INDEX BF NETHERLANDS GOVT. ST EUR	34	0	17	17 EUR	83'010.89	1'377'406.84	1.27 a)
CH0302432254	SWC (CH) INDEX BF SPAIN GOVT. ST EUR	99	8	55	51 EUR	91'607.39	4'657'393.30	4.29 a)
EUR							30'874'936.81	28.47
CH0302468605	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. ST GBP	79	12	44	46 GBP	86'166.45	4'541'290.35	4.19 a)
GBP							4'541'290.35	4.19

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Währ- ung	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Derivative Finanzinstrumente					0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							
	CHF/USD Verfall 04.05.2022	257'546	250'000	USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/USD Verfall 07.06.2022	258'867	33'300'000	USD/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.08.2022	275'000	285'567	CHF/USD	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte					0.00	0.00	

Vermögensaufstellung					Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht					255'298.38	0.24
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte					61'467'769.59	56.68
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen					46'308'741.29	42.70
Sonstige Vermögenswerte					408'997.20	0.38
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode					108'440'806.46	100.00
Andere Verbindlichkeiten					-2'669.61	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode					108'438'136.85	

Bewertungskategorien					Kurswert CHF	in % 7)
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);				107'776'510.88	99.39
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

Ausgeliehene Effekten	22'406'438.49	20.66
------------------------------	----------------------	--------------

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte					22'406'438.49	20.66
US912810QS06	3.7500 % T 3 3/4 08/15/41	169	USD	95.88%	151'861.45	0.14
US912810QZ49	3.1250 % T 3 1/8 02/15/43	165	USD	86.13%	133'189.08	0.12
US912810RY64	2.7500 % T 2 3/4 08/15/47	120	USD	79.50%	89'413.65	0.08
US912810SD19	3.0000 % T 3 08/15/48	100	USD	83.45%	78'216.44	0.07
US912810SN90	1.2500 % T 1 1/4 05/15/50	220	USD	55.48%	114'406.02	0.11
US912810SP49	1.3750 % T 1 3/8 08/15/50	400	USD	57.34%	214'981.72	0.20
US912810SQ22	1.1250 % T 1 1/8 08/15/40	150	USD	62.92%	88'460.30	0.08
US912810SR05	1.1250 % T 1 1/8 05/15/40	330	USD	63.27%	195'675.82	0.18
US912810SU34	1.8750 % T 1 7/8 02/15/51	550	USD	65.31%	336'677.77	0.31
US912810SW99	1.8750 % T 1 7/8 02/15/41	400	USD	71.41%	267'702.03	0.25
US912810SZ21	2.0000 % T 2 08/15/51	300	USD	67.23%	189'046.27	0.17
US912810TA60	1.7500 % T 1 3/4 08/15/41	394	USD	69.25%	255'723.98	0.24
US912810TB44	1.8750 % T 1 7/8 11/15/51	510	USD	65.06%	310'997.12	0.29
US912810TD00	2.2500 % T 2 1/4 02/15/52	250	USD	71.33%	167'130.70	0.15
US912810TG31	2.8750 % T 2 7/8 05/15/52	265	USD	81.91%	203'431.57	0.19
US9128282A70	1.5000 % T 1 1/2 08/15/26	390	USD	90.75%	331'716.21	0.31
US9128283P31	2.2500 % T 2 1/4 12/31/24	5	USD	95.41%	4'470.97	0.00
US9128283V09	2.5000 % T 2 1/2 01/31/25	200	USD	95.77%	179'512.65	0.17
US9128284N73	2.8750 % T 2 7/8 05/15/28	390	USD	93.88%	343'138.94	0.32
US9128284V99	2.8750 % T 2 7/8 08/15/28	270	USD	93.69%	237'083.25	0.22
US9128285M81	3.1250 % T 3 1/8 11/15/28	350	USD	94.77%	310'866.77	0.29
US9128285Z94	2.5000 % T 2 1/2 01/31/24	440	USD	97.64%	402'660.15	0.37
US9128286B18	2.6250 % T 2 5/8 02/15/29	430	USD	92.05%	370'965.03	0.34
US9128286L99	2.2500 % T 2 1/4 03/31/26	100	USD	93.72%	87'837.90	0.08
US9128286R69	2.2500 % T 2 1/4 04/30/24	300	USD	96.75%	272'036.81	0.25
US9128286T26	2.3750 % T 2 3/8 05/15/29	340	USD	90.47%	288'292.24	0.27
US9128286Z85	1.7500 % T 1 3/4 06/30/24	250	USD	95.70%	224'244.37	0.21
US912828B667	2.7500 % T 2 3/4 02/15/24	583	USD	97.75%	534'122.37	0.49
US912828G385	2.2500 % T 2 1/4 11/15/24	333	USD	95.64%	298'498.44	0.28
US912828J272	2.0000 % T 2 02/15/25	408	USD	94.77%	362'381.84	0.33

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Währ- 28.02.2023 ung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7) Kat.
US912828M565	2.2500 % T 2 1/4 11/15/25	410 USD	94.16%	361'816.58	0.33
US912828P469	1.6250 % T 1 5/8 02/15/26	380 USD	92.09%	327'996.50	0.30
US912828U246	2.0000 % T 2 11/15/26	340 USD	91.94%	292'972.63	0.27
US912828W713	2.1250 % T 2 1/8 03/31/24	235 USD	96.80%	213'198.76	0.20
US912828WJ58	2.5000 % T 2 1/2 05/15/24	166 USD	96.92%	150'794.45	0.14
US912828X885	2.3750 % T 2 3/8 05/15/27	260 USD	92.66%	225'789.38	0.21
US912828XT22	2.0000 % T 2 05/31/24	510 USD	96.22%	459'923.22	0.42
US912828YB05	1.6250 % T 1 5/8 08/15/29	400 USD	86.42%	323'995.63	0.30
US912828YE44	1.2500 % T 1 1/4 08/31/24	300 USD	94.52%	265'754.29	0.25
US912828YH74	1.5000 % T 1 1/2 09/30/24	400 USD	94.70%	355'042.00	0.33
US912828YS30	1.7500 % T 1 3/4 11/15/29	350 USD	87.00%	285'392.63	0.26
US912828YV68	1.5000 % T 1 1/2 11/30/24	500 USD	94.31%	441'971.95	0.41
US912828Z781	1.5000 % T 1 1/2 01/31/27	230 USD	89.86%	193'707.62	0.18
US912828ZL77	0.3750 % T 0 3/8 04/30/25	350 USD	91.09%	298'821.66	0.28
US912828ZQ64	0.6250 % T 0 5/8 05/15/30	380 USD	79.06%	281'585.05	0.26
US912828ZT04	0.2500 % T 0 1/4 05/31/25	250 USD	90.58%	212'235.86	0.20
US91282CAB72	0.2500 % T 0 1/4 07/31/25	450 USD	90.08%	379'915.73	0.35
US91282CAE12	0.6250 % T 0 5/8 08/15/30	300 USD	78.63%	221'073.84	0.20
US91282CAJ09	0.2500 % T 0 1/4 08/31/25	200 USD	89.81%	168'353.53	0.16
US91282CAL54	0.3750 % T 0 3/8 09/30/27	450 USD	84.08%	354'609.98	0.33
US91282CAM38	0.2500 % T 0 1/4 09/30/25	500 USD	89.64%	420'078.36	0.39
US91282CAV37	0.8750 % T 0 7/8 11/15/30	750 USD	79.91%	561'691.00	0.52
US91282CAY75	0.6250 % T 0 5/8 11/30/27	600 USD	84.72%	476'415.89	0.44
US91282CAZ41	0.3750 % T 0 3/8 11/30/25	300 USD	89.33%	251'168.34	0.23
US91282CBA80	0.1250 % T 0 1/8 12/15/23	200 USD	96.19%	180'303.47	0.17
US91282CBH34	0.3750 % T 0 3/8 01/31/26	300 USD	88.83%	249'762.47	0.23
US91282CBJ99	0.7500 % T 0 3/4 01/31/28	155 USD	84.86%	123'278.40	0.11
US91282CBL46	1.1250 % T 1 1/8 02/15/31	550 USD	81.36%	419'397.43	0.39
US91282CBP59	1.1250 % T 1 1/8 02/29/28	100 USD	86.31%	80'896.39	0.07
US91282CBQ33	0.5000 % T 0 1/2 02/28/26	212 USD	88.89%	176'622.99	0.16
US91282CBT71	0.7500 % T 0 3/4 03/31/26	312 USD	89.47%	261'626.31	0.24
US91282CCB54	1.6250 % T 1 5/8 05/15/31	600 USD	84.06%	472'725.47	0.44
US91282CCE93	1.2500 % T 1 1/4 05/31/28	370 USD	86.36%	299'479.22	0.28
US91282CCG42	0.2500 % T 0 1/4 06/15/24	400 USD	93.95%	352'230.25	0.32
US91282CCJ80	0.8750 % T 0 7/8 06/30/26	350 USD	89.13%	292'363.42	0.27
US91282CCP41	0.6250 % T 0 5/8 07/31/26	100 USD	88.09%	82'565.87	0.08
US91282CCR07	1.0000 % T 1 07/31/28	200 USD	84.81%	158'981.03	0.15
US91282CCV19	1.1250 % T 1 1/8 08/31/28	320 USD	85.23%	255'634.96	0.24
US91282CCX74	0.3750 % T 0 3/8 09/15/24	450 USD	93.17%	392'964.05	0.36
US91282CCY57	1.2500 % T 1 1/4 09/30/28	280 USD	85.64%	224'746.68	0.21
US91282CDF59	1.3750 % T 1 3/8 10/31/28	400 USD	86.09%	322'765.47	0.30
US91282CDJ71	1.3750 % T 1 3/8 11/15/31	565 USD	81.39%	431'000.97	0.40
US91282CDK45	1.2500 % T 1 1/4 11/30/26	650 USD	89.31%	544'102.91	0.50
US91282CDL28	1.5000 % T 1 1/2 11/30/28	400 USD	86.59%	324'639.97	0.30
US91282CDN83	1.0000 % T 1 12/15/24	18 USD	93.33%	15'744.92	0.01
US91282CDP32	1.3750 % T 1 3/8 12/31/28	170 USD	85.91%	136'876.58	0.13
US91282CDY49	1.8750 % T 1 7/8 02/15/32	638 USD	84.72%	506'588.90	0.47
US91282CEE75	2.3750 % T 2 3/8 03/31/29	350 USD	90.63%	297'283.98	0.27
US91282CEP23	2.8750 % T 2 7/8 05/15/32	386 USD	91.98%	332'779.71	0.31
US91282CFF32	2.7500 % T 2 3/4 08/15/32	500 USD	90.88%	425'862.97	0.39
US91282CFV81	4.1250 % T 4 1/8 11/15/32	500 USD	101.61%	476'166.96	0.44

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.63203454
CAD	1 = CHF	0.68842043
CNY	1 = CHF	0.13482314
EUR	1 = CHF	0.99395514
GBP	1 = CHF	1.13468171
JPY	100 = CHF	0.68806700
USD	1 = CHF	0.93725000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	6'033'940.00	25.004
Bond	CHF	18'066'030.00	74.863
Equity	CHF	32'225.46	0.134
Total	CHF	24'132'195.46	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.073	0.00 - 0.01	-	0.005
FA CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.073	0.00 - 0.01	-	0.005
GT CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.073	0.00 - 0.01	-	0.005
NT CHF	CHF	0.00 - 0.12	-	0.073	0.00 - 0.01	-	0.005

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	22'406'438.49
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2022 - 28.02.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %		PAF p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max	Eff		Eff		Eff	
DT CHF	0.180	0.400	0.130		0.050		3.000	
FA CHF	0.180	0.500	0.130		0.050		3.000	
GT CHF	0.140	0.350	0.090		0.050		3.000	
NT CHF	-	-	-		-		3.000	

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

9 Benchmark

FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR

10 TER

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

11 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	1.50000	0.52500	0.97500

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.06.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.06.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	1.495	0.523	0.972
GT CHF	Nein	CHF	1.467	0.513	0.954
NT CHF	Nein	CHF	1.682	0.588	1.094

13 Fussnoten

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

14 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(im Folgenden "der Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

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

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

Umbenennung des Teilvermögens Swisssanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisssanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF	Swisssanto (CH) Index Commodity Fund

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

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

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

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

Zürich, 15. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisssanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible

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

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF

(neu: **Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked**)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

(nachfolgend „die Teilvermögen“)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2. Umbenennung von Anteilsklassen

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

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

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

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

3. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

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

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

4. Soft Closing

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

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

5. Gating

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

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

an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den Schwellenwert von CHF 10 Mio. übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge stattfindet.

Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

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

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

Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

6. Keine Regelung der Umwandlung mehr

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

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

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

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

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

Zürich, 29. Juni 2022

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

Zurzeit mit den Teilvermögen

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

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

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

Zudem sollen die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible künftig als Zielfonds von anderen kollektiven Kapitalanlagen der Swisscanto Fondsleitung AG dienen. Die diesbezüglichen Anpassungen des Fondsvertrages werden unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung aufgeführt.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible als Zielfonds

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible sollen neu als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlagen (Dachfonds) dienen:

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

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

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

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

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

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage (Dachfonds), für welche die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible als Zielfonds fungieren, soll (wie bereits erwähnt) gemäss der Risikoverteilungsvorschrift jeweils bis zu 100% der Anteile des jeweiligen Zielfonds erwerben können (vgl. dazu für das Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des jeweiligen Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den jeweiligen Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Entsprechende Hinweise bzw. Ergänzungen werden in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

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

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

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

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

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

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

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

Zürich, 16. Januar 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich