

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND AUSTRIA GOVT.

## Jahresbericht per 31.01.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
NT EUR	21580394	EUR
ST EUR	30243204	EUR

Rechnungswährung: EUR

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

Zürich, 26. Mai 2023

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

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

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund II,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 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), geprüft.

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



### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

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

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



### **Sonstige Informationen**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die in einem Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnungen und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zu den Jahresrechnungen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zu den Jahresrechnungen oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.



### **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.

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 31. Januar 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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	9
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	9
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	10
7	Pauschale Verwaltungskommission	10
8	Benchmark	10
9	TER	10
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	11
11	Fussnoten	11
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte Pflichtpublikationen	12 14

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020	01.02.2019
	bis	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021	31.01.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		17'028'013.92	20'514'679.85	24'788'837.74	25'226'403.22
<b>Klasse NT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'363'148.16	6'673'408.03	7'933'967.25	8'181'716.24
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		57'151.412	57'838.117	64'199.247	66'866.758
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		93.8410	115.3808	123.5835	122.3585
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		93.6352	120.4238	133.5664	130.7778
Thesaurierung je Anteil		1.51	1.68	2.05	2.32
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse ST EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'664'865.76	13'841'271.82	16'854'870.49	17'044'686.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		136.931	132.147	150.238	153.451
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		85'187.9104	104'741.4759	112'187.7986	111'075.7635
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		85'001.0238	109'319.4978	121'250.2164	118'718.7155
Thesaurierung je Anteil		1'378.28	1'525.48	1'869.92	2'107.44
Total Expense Ratio (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 NT EUR	-18.21 %	-21.38 %	-5.91 %	6.04 %
Klasse ST EUR	-18.21 %	-21.38 %	-5.91 %	6.04 %
Benchmark	-18.34 %	-21.52 %	-5.89 %	5.96 %
Tracking Error 33)	0.07 %	0.07 %	0.05 %	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 NT EUR	0.13 %
Klasse ST EUR	0.13 %

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.



## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2023	31.01.2022
Bankguthaben auf Sicht	57'352.24	137'789.14
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	16'796'599.00	20'210'554.15
Sonstige Vermögenswerte	174'062.68	166'336.56
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>17'028'013.92</b>	<b>20'514'679.85</b>
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>17'028'013.92</b>	<b>20'514'679.85</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse NT EUR	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		57'838.117	64'199.247
Ausgegebene Anteile		-	1'489.535
Zurückgenommene Anteile		-686.705	-7'850.665
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>57'151.412</b>	<b>57'838.117</b>

Klasse ST EUR	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		132.147	150.238
Ausgegebene Anteile		36.758	16.769
Zurückgenommene Anteile		-31.974	-34.860
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>136.931</b>	<b>132.147</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		20'514'679.85	24'788'837.74
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-99'492.47	-153'363.25
Saldo aus dem Anteilverkehr		222'337.98	-2'620'887.19
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-3'609'511.44	-1'499'907.45
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>17'028'013.92</b>	<b>20'514'679.85</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
<b>Ertrag</b>			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-205.96	-448.11
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		262'656.11	339'276.02
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		34'749.97	8'962.89
<b>Total Ertrag</b>		<b>297'200.12</b>	<b>347'790.80</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-11.78
Sonstige Aufwendungen		0.00	-4.68
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-21'697.67	-48'992.91
<b>Total Aufwand</b>		<b>-21'697.67</b>	<b>-49'009.37</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>275'502.45</b>	<b>298'781.43</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-307'291.38	-174'428.09
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		10'244.24	4'987.80
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-21'544.69</b>	<b>129'341.14</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'587'966.75	-1'629'248.59
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-3'609'511.44</b>	<b>-1'499'907.45</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse NT EUR</b>	<b>31.01.2023</b>	<b>31.01.2022</b>
Nettoertrag	86'772.48	97'193.26
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>86'772.48</b>	<b>97'193.26</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	30'370.37	34'017.64
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	56'402.11	63'175.62
<b>Total</b>	<b>86'772.48</b>	<b>97'193.26</b>

<b>Klasse ST EUR</b>	<b>31.01.2023</b>	<b>31.01.2022</b>
Nettoertrag	188'729.97	201'588.17
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>188'729.97</b>	<b>201'588.17</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	66'055.49	70'555.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	122'674.48	131'032.31
<b>Total</b>	<b>188'729.97</b>	<b>201'588.17</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>16'796'599.00</b>	<b>98.64</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>16'796'599.00</b>	<b>98.64</b>	
AT0000383864	6.2500 % RAGB 6 1/4 07/15/27	710	160	135	735 EUR	114.86%	844'228.35	4.96	a)
AT0000A04967	4.1500 % RAGB 4.15 03/15/37	1'178	95	180	1'093 EUR	113.30%	1'238'336.21	7.27	a)
AT0000A0DXC2	4.8500 % RAGB 4.85 03/15/26	698	97	111	684 EUR	106.66%	729'554.40	4.28	a)
AT0000A0U299	3.8000 % RAGB 3.8 01/26/62	292	20	35	277 EUR	119.98%	332'344.60	1.95	a)
AT0000A0VRQ6	3.1500 % RAGB 3.15 06/20/44	558	40	59	539 EUR	103.26%	556'571.40	3.27	a)
AT0000A105W3	1.7500 % RAGB 1 3/4 10/20/23	887	60	947	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A10683	2.4000 % RAGB 2.4 05/23/34	679	0	54	625 EUR	94.88%	593'000.00	3.48	a)
AT0000A185T1	1.6500 % RAGB 1.65 10/21/24 1	813	0	30	783 EUR	98.24%	769'219.20	4.52	a)
AT0000A1FAP5	1.2000 % RAGB 1.2 10/20/25	852	50	0	902 EUR	96.43%	869'798.60	5.11	a)
AT0000A1K9C8	0.7500 % RAGB 0 3/4 10/20/26	1'162	110	135	1'137 EUR	93.35%	1'061'412.24	6.23	a)
AT0000A1K9F1	1.5000 % RAGB 1 1/2 02/20/47	644	160	60	744 EUR	75.75%	563'565.12	3.31	a)
AT0000A1PE50	0.0000 % RAGB 0 07/15/23	755	0	755	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A1PEF7	1.5000 % RAGB 1 1/2 11/02/2086	209	10	25	194 EUR	62.68%	121'599.20	0.71	a)
AT0000A1VGK0	0.5000 % RAGB 0 1/2 04/20/27	860	70	0	930 EUR	91.55%	851'415.00	5.00	a)
AT0000A1XML2	2.1000 % RAGB 2.1 09/20/2117	462	40	54	448 EUR	76.45%	342'496.00	2.01	a)
AT0000A1ZGE4	0.7500 % RAGB 0 3/4 02/20/28	857	0	30	827 EUR	91.04%	752'900.80	4.42	a)
AT0000A269M8	0.5000 % RAGB 0 1/2 02/20/29	923	100	27	996 EUR	87.71%	873'591.60	5.13	a)
AT0000A28KX7	0.0000 % RAGB 0 07/15/24	858	125	145	838 EUR	96.18%	805'996.78	4.73	a)
AT0000A2CQD2	0.0000 % RAGB 0 02/20/30	829	165	50	944 EUR	82.46%	778'422.40	4.57	a)
AT0000A2EJ08	0.7500 % RAGB 0 3/4 03/20/51	468	155	20	603 EUR	59.88%	361'076.40	2.12	a)
AT0000A2EJZ6	0.0000 % RAGB 0 04/20/23	471	0	471	0 EUR	0.00%	0.00	0.00	
AT0000A2HLC4	0.8500 % RAGB 0.85 06/30/2120	285	75	25	335 EUR	43.11%	144'418.50	0.85	a)
AT0000A2KQ43	0.0000 % RAGB 0 10/20/40	343	115	40	418 EUR	59.47%	248'584.60	1.46	a)
AT0000A2NW83	0.0000 % RAGB 0 02/20/31	817	147	0	964 EUR	79.90%	770'236.00	4.52	a)
AT0000A2QQB6	0.7000 % RAGB 0.7 04/20/2071	223	55	20	258 EUR	46.63%	120'305.40	0.71	a)
AT0000A2QRW0	0.0000 % RAGB 0 04/20/25	470	295	50	715 EUR	94.21%	673'601.50	3.96	a)
AT0000A2T198	0.2500 % RAGB 0 1/4 10/20/36	404	40	0	444 EUR	69.65%	309'246.00	1.82	a)
AT0000A2VB47	0.0000 % RAGB 0 10/20/28	178	250	0	428 EUR	85.77%	367'074.20	2.16	a)
AT0000A2WSC8	0.9000 % RAGB 0.9 02/20/32	0	860	0	860 EUR	84.58%	727'388.00	4.27	a)
AT0000A2Y8G4	1.8500 % RAGB 1.85 05/23/49	0	299	0	299 EUR	81.40%	243'386.00	1.43	a)
AT0000A308C5	2.0000 % RAGB 2 07/15/26	0	355	0	355 EUR	97.79%	347'154.50	2.04	a)
AT0000A324S8	2.9000 % RAGB 2.9 02/20/33	0	400	0	400 EUR	99.92%	399'676.00	2.35	a)
<b>EUR</b>							<b>16'796'599.00</b>	<b>98.64</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	EUR/CHF Verfall 04.05.2022		800'000	781'315	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 28.12.2022		320'000	325'474	CHF/EUR		0.00	0.00	
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Vermögensaufstellung</b>							<b>Kurswert EUR</b>	<b>in % 7)</b>	
Bankguthaben auf Sicht							57'352.24	0.34	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							16'796'599.00	98.64	
Sonstige Vermögenswerte							174'062.68	1.02	
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>							<b>17'028'013.92</b>	<b>100.00</b>	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>							<b>17'028'013.92</b>		

Bewertungskategorien		Kurswert EUR	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);	16'796'599.00	98.64
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

CHF 1 = EUR 1.00219864

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

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

Periode: 01.02.2022 - 31.01.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
NT EUR	EUR	0.00 - 0.35	-	0.200	-	-	-
ST EUR	EUR	0.00 - 0.35	-	0.200	-	-	-

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

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	EUR	-
Andere Wertpapiere	EUR	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2022 - 31.01.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %		PAF p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff	Eff	Eff	
NT EUR	-	-	-	-	-	-	-	
ST EUR	-	-	-	-	-	-	-	

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

## 8 Benchmark

FTSE Austrian Government Bond Index

## 9 TER

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

## 10 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 15.05.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.05.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT EUR	Ja	EUR	1.518	0.531	0.987
ST EUR	Ja	EUR	1'378.28	482.39	895.89

## 11 Fussnoten

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

## 12 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 Konstanthaltung 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 zugezählt 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 eines 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 Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der

verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

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



**Mitteilung an die Anleger**

des

**Swisscanto (CH) Index Fund II**

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

(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.**

**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.**

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

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH**

**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH**

(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.

Im Fondsvertrag werden bestehende Anteilsklassen umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 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 von Anteilsklassen

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

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

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

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

## 2. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 10 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."

## 3. Keine Regelung der Umwandlung mehr

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

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 und Ziff. 2 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. 2 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