

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND SWITZERLAND TOTAL (I)

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	11704371	CHF
FA CHF	31562299	CHF
GT CHF	33096859	CHF
MT CHF	51788856	CHF
NT CHF	11704370	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

mit den Teilvermögen

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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende 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 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.



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 Erfolgsrechnungen für den Zeitraum vom 31. Oktober 2022 bis 29. Februar 2024 für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	13
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
8	Pauschale Verwaltungskommission	15
9	Benchmark	15
10	TER	15
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	16
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	16
13	Ausschüttung des Kapitalgewinns 2023 / 2024	16
14	Fussnoten	17
15	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18
16	Pflichtpublikationen	20

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'198'308'790.84	3'948'405'426.48	4'080'406'529.44	3'692'224'826.83
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		38'658'609.85	31'759'165.31	25'072'516.37	95'521'799.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		169'081.072	142'836.376	105'341.406	459'544.740
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		228.6395	222.3465	238.0120	207.8618
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		239.9449	223.6987	230.9711	189.1627
Thesaurierung je Anteil		6.01	5.54	5.00	4.93
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.15 %	0.15 %
Klasse FA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		65'224'374.12	40'515'924.23	37'707'077.60	28'657'060.69
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		438'556.798	275'631.628	235'864.871	202'238.076
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		148.7250	146.9930	159.8673	141.6996
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		156.0789	147.8870	155.1381	128.9525
Ausschüttung je Anteil		4.00	3.70	3.40	3.60
Kapitalausschüttung je Anteil		0.20	-	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.15 %	0.15 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		807'674'706.15	884'458'366.82	1'046'968'800.78	680'827'792.44
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'081'499.732	5'722'457.541	6'328'440.467	4'712'547.308
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		158.9442	154.5592	165.4387	144.4713
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		166.8034	155.4992	160.5447	131.4748
Thesaurierung je Anteil		4.19	3.87	3.49	3.44
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse MT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		82'971'685.77	53'911'228.29	23'829'967.48	10'291'931.13
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		747'137.141	499'692.573	206'548.644	102'262.252
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.0528	107.8888	115.3722	100.6425
Thesaurierung je Anteil		3.08	2.85	2.60	2.51
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'203'779'414.95	2'937'760'741.83	2'946'828'167.21	2'876'926'243.36
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'759'911.296	12'987'408.399	12'181'129.256	13'631'924.710
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		232.8343	226.2007	241.9175	211.0433
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		244.3471	227.5764	234.7611	192.0580
Thesaurierung je Anteil		6.46	5.98	5.45	5.30
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

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	3.71 %	5.92 %	-16.56 %	23.20 %
Klasse FA CHF	3.72 %	5.93 %	-16.57 %	23.20 %
Klasse GT CHF	3.72 %	5.93 %	-16.55 %	23.21 %
Klasse MT CHF	3.87 %	6.08 %	-16.43 %	23.38 %
Klasse NT CHF	3.87 %	6.08 %	-16.44 %	23.38 %
Benchmark	3.87 %	6.09 %	-16.48 %	23.38 %
Tracking Error 33)	0.02 %	0.02 %	0.03 %	0.03 %

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	-0.16 %
Klasse FA CHF	-0.15 %
Klasse GT CHF	-0.15 %
Klasse MT CHF	-
Klasse NT CHF	-

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	10'574'659.80	10'549'952.78
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	4'176'200'304.05	3'928'102'037.29
Sonstige Vermögenswerte	11'634'645.34	9'857'968.32
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'198'409'609.19	3'948'509'958.39
Andere Verbindlichkeiten	-100'818.35	-104'531.91
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	4'198'308'790.84	3'948'405'426.48

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		142'836.376	105'341.406
Ausgegebene Anteile		35'792.091	132'168.368
Zurückgenommene Anteile		-9'547.395	-94'673.398
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		169'081.072	142'836.376
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		275'631.628	235'864.871
Ausgegebene Anteile		187'109.761	59'768.323
Zurückgenommene Anteile		-24'184.591	-20'001.566
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		438'556.798	275'631.628
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'722'457.541	6'328'440.467
Ausgegebene Anteile		1'920'459.540	2'223'055.378
Zurückgenommene Anteile		-2'561'417.349	-2'829'038.304
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'081'499.732	5'722'457.541
Klasse MT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		499'692.573	206'548.644
Ausgegebene Anteile		247'444.568	293'187.929
Zurückgenommene Anteile		-	-44.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		747'137.141	499'692.573
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'987'408.399	12'181'129.256
Ausgegebene Anteile		2'135'550.014	1'529'066.760
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		86'747.656	733'472.881
Zurückgenommene Anteile		-1'449'794.773	-1'456'260.498
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'759'911.296	12'987'408.399

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	14.03.2023	4'785'258.04	21'688.965
Klasse NT CHF	14.03.2023	1'487'722.56	6'743.035
Klasse NT CHF	14.03.2023	1'807'600.66	8'192.868
Klasse NT CHF	12.06.2023	11'825'915.47	50'122.788

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'948'405'426.48	4'080'406'529.44
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'231'042.62	-856'301.41
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-36'807'866.49	-32'041'210.98
Saldo aus dem Anteilverkehr		125'785'535.97	121'102'489.22
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		162'156'737.50	-220'206'079.79
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'198'308'790.84	3'948'405'426.48

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		50'825.34	17.68
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-28'850.34
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		114'806'392.80	96'802'853.70
Erträge der Gratisaktien		8'697.00	5'787.09
Erträge aus Wertpapierleihe		626'322.55	568'122.80
Sonstige Erträge		-21.25	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		20'361'157.89	20'924'850.74
Total Ertrag		135'853'374.33	118'272'781.67
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-2'797.80
Reglementarische Vergütungen		-1'406'447.62	-1'394'221.98
Sonstige Aufwendungen		0.00	-1'119.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-19'101'480.30	-13'776'519.73
Total Aufwand		-20'507'927.92	-15'174'658.66
Nettoertrag / Verlust		115'345'446.41	103'098'123.01
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		48'549'046.24	49'961'565.96
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		8'943'502.89	9'125'949.15
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		248'516.89	234'652.46
Realisierter Erfolg		173'086'512.43	162'420'290.58
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-10'929'774.93	-382'626'370.37
Gesamterfolg		162'156'737.50	-220'206'079.79

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	1'017'181.17	792'581.36
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'017'181.17	792'581.36
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	356'013.41	277'403.48
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	661'167.76	515'177.88
Total	1'017'181.17	792'581.36
<hr/>		
Klasse FA CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	1'750'345.04	1'027'601.04
Vortrag des Vorjahres	11'545.68	3'781.67
Zur Ausschüttung bestimmte Kapitalgewinne des Rechnungsjahres	87'711.36	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'849'602.08	1'031'382.71
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'841'938.56	1'019'837.03
Vortrag auf neue Rechnung	7'663.52	11'545.68
Total	1'849'602.08	1'031'382.71
<hr/>		
Klasse GT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	21'329'597.76	22'160'438.28
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	21'329'597.76	22'160'438.28
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'465'359.22	7'756'153.40
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	13'864'238.54	14'404'284.88
Total	21'329'597.76	22'160'438.28
<hr/>		
Klasse MT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	2'303'496.64	1'425'575.81
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	2'303'496.64	1'425'575.81
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	806'223.82	498'951.53
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'497'272.82	926'624.28
Total	2'303'496.64	1'425'575.81
<hr/>		
Klasse NT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	88'944'825.80	77'691'926.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	88'944'825.80	77'691'926.52
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	31'130'689.03	27'192'174.28
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	57'814'136.77	50'499'752.24
Total	88'944'825.80	77'691'926.52

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							4'176'200'304.05	99.47	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							4'176'200'304.05	99.47	
AT0000A18XM4	AMS-OSRAM AG	701'553	2'266'106	192'931	2'774'728 CHF	1.35	3'737'558.62	0.09	a)
AT0000KTMIO2	PIERER MOBILITY AG	24'435	4'025	2'569	25'891 CHF	46.10	1'193'575.10	0.03	a)
AT							4'931'133.72	0.12	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	492'701	83'794	18'815	557'680 CHF	4.21	2'347'832.80	0.06	a)
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	224	0	0	224 CHF	3'720.00	833'280.00	0.02	a)
CH0001340204	GRAUBUENDNER KANTONALBANK-PC	1'931	0	0	1'931 CHF	1'780.00	3'437'180.00	0.08	a)
CH0001341608	HYPOTHEKARBANK LENZBURG-REG	70	0	0	70 CHF	4'340.00	303'800.00	0.01	a)
CH0001473559	BASELLANDS KANTONALBANK-CERT	2'037	0	0	2'037 CHF	854.00	1'739'598.00	0.04	a)
CH0001624714	CPH CHEMIE & PAPIER HLDG-REG	1'932	0	0	1'932 CHF	85.00	164'220.00	0.00	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	150'320	35'144	26'267	159'197 CHF	27.82	4'428'860.54	0.11	a)
CH0002187810	PHOENIX MECANO AG-BR	1'926	0	1'926	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002277314	SCHLATTER INDUSTRIES AG	374	0	0	374 CHF	23.60	8'826.40	0.00	a)
CH0002361068	STARRAGTORNOS GROUP AG	1'104	2'562	0	3'666 CHF	46.00	168'636.00	0.00	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	16'760	4'867	3'858	17'769 CHF	374.20	6'649'159.80	0.16	a)
CH0002497458	SGS SA-REG	15'512	942	16'454	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	544	0	0	544 CHF	1'865.00	1'014'560.00	0.02	a)
CH0003245351	VON ROLL HOLDING AG-BR	135'937	0	135'937	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	2'982	0	0	2'982 CHF	16.95	50'544.90	0.00	a)
CH0003420806	ORELL FUJESSLI HOLDING AG-REG	1'305	0	0	1'305 CHF	74.20	96'831.00	0.00	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	2'854	425	450	2'829 CHF	1'016.00	2'874'264.00	0.07	a)
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	6'750	1'118	0	7'868 CHF	93.80	738'018.40	0.02	a)
CH0005319162	ELMA ELECTRONIC AG-REG	19	0	0	19 CHF	1'000.00	19'000.00	0.00	a)
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	1'926'411	0	0	1'926'411 CHF	0.09	175'110.76	0.00	a)
CH0006089921	PRIVATE EQUITY HLDG-REG	10'070	0	0	10'070 CHF	68.00	684'760.00	0.02	a)
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	1'772	526	164	2'134 CHF	2'780.00	5'932'520.00	0.14	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	196'646	56'722	43'927	209'441 CHF	84.50	17'697'764.50	0.42	a)
CH0008207356	BVZ HOLDING AG-REG NEW	162	0	0	162 CHF	930.00	150'660.00	0.00	a)
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	4'183	0	0	4'183 CHF	51.40	215'006.20	0.01	a)
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	65'634	13'708	9'152	70'190 CHF	505.40	35'474'026.00	0.84	a)
CH0008837566	ALLREAL HOLDING AG-REG	40'471	12'516	7'282	45'705 CHF	152.00	6'947'160.00	0.17	a)
CH0008967926	ADVAL TECH HOLDING AG-REG	33	0	0	33 CHF	100.00	3'300.00	0.00	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	9'174	1'918	1'354	9'738 CHF	1'242.00	12'094'596.00	0.29	a)
CH0009062099	SCHAFFNER HOLDING AG-REG	1'003	0	1'003	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0009236461	BASLER KANTONALBK - PC	19'560	0	0	19'560 CHF	67.60	1'322'256.00	0.03	a)
CH0009320091	FEINTOOL INTL HOLDING-REG	18'708	0	0	18'708 CHF	19.00	355'452.00	0.01	a)
CH0009691608	BERNER KANTONALBANK AG-REG	12'919	0	0	12'919 CHF	240.00	3'100'560.00	0.07	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	281	41	25	297 CHF	106'200.00	31'541'400.00	0.75	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2'622	786	613	2'795 CHF	10'820.00	30'241'900.00	0.72	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	20'467	4'011	2'540	21'938 CHF	3'707.00	81'324'166.00	1.94	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	28'352	5'671	3'515	30'508 CHF	235.00	7'169'380.00	0.17	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	10'036	2'341	864	11'513 CHF	164.40	1'892'737.20	0.05	a)
CH0010754924	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG-BR	2'698	158	2'856	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011003594	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-BR	555	0	555	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	4'487	679	294	4'872 CHF	1'370.00	6'674'640.00	0.16	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	386'475	73'159	56'487	403'147 CHF	470.00	189'479'090.00	4.51	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	19'595	4'518	2'990	21'123 CHF	259.00	5'470'857.00	0.13	a)
CH0011115703	CREALOGIX HOLDING AG-REG	1'528	0	1'528	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011178255	TX GROUP AG	9'110	0	0	9'110 CHF	133.20	1'213'452.00	0.03	a)
CH0011339204	ASCOM HOLDING AG-REG	115'933	12'315	10'400	117'848 CHF	7.38	869'718.24	0.02	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	33'001	11'759	4'825	39'935 CHF	35.15	1'403'715.25	0.03	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	9'381	136	340	9'177 CHF	499.50	4'583'911.50	0.11	a)
CH0011607683	TORNOS HOLDING AG - REG	24'195	0	24'195	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011693600	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	8'883	0	8'883	0 CHF	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0011795959	DORMAKABA HOLDING AG	7'721	2'011	877	8'855	CHF	459.00	4'064'445.00	0.10 a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	5'863'618	992'437	1'030'953	5'825'102	CHF	89.49	521'288'377.98	12.42 a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1'803'132	362'998	230'459	1'935'671	CHF	231.95	448'978'888.45	10.69 a)
CH0012032113	ROCHE HOLDING AG-BR	69'942	18'790	7'647	81'085	CHF	245.40	19'898'259.00	0.47 a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	32'866	5'189	3'019	35'036	CHF	344.80	12'080'412.80	0.29 a)
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	9'291'086	779'204	10'070'290	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	426'623	105'448	71'155	460'916	CHF	35.43	16'330'253.88	0.39 a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	582'451	105'759	67'328	620'882	CHF	10.94	6'792'449.08	0.16 a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	1'445'524	260'848	242'847	1'463'525	CHF	72.10	105'520'152.50	2.51 a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	4'166'734	1'008'623	727'417	4'447'940	CHF	40.72	181'120'116.80	4.31 a)
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	147'012	25'919	18'966	153'965	CHF	40.45	6'227'884.25	0.15 a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	73'359	15'660	9'834	79'185	CHF	208.60	16'517'991.00	0.39 a)
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	115'126	0	0	115'126	CHF	1.46	167'508.33	0.00 a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	71'787	10'726	4'602	77'911	CHF	54.00	4'207'194.00	0.10 a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	116'956	22'305	13'556	125'705	CHF	142.60	17'925'533.00	0.43 a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	172'323	33'839	27'306	178'856	CHF	66.30	11'858'152.80	0.28 a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	130'008	27'348	21'801	135'555	CHF	272.30	36'911'626.50	0.88 a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	5'526	1'046	550	6'022	CHF	900.00	5'419'800.00	0.13 a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	23'449	12'334	0	35'783	CHF	81.30	2'909'157.90	0.07 a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	191'201	40'283	26'681	204'803	CHF	462.00	94'618'986.00	2.25 a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	10'897	2'045	1'651	11'291	CHF	886.00	10'003'826.00	0.24 a)
CH0014345117	COMPAGNIE FINANCIERE TRAD-BR	4'732	47	0	4'779	CHF	118.50	566'311.50	0.01 a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	43'750	9'956	3'171	50'535	CHF	102.60	5'184'891.00	0.12 a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	78'742	16'388	13'965	81'165	CHF	641.60	52'075'464.00	1.24 a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	17'330	4'648	3'669	18'309	CHF	616.50	11'287'498.50	0.27 a)
CH0017875789	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG	14'194	0	0	14'194	CHF	168.00	2'384'592.00	0.06 a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	117'725	36'175	29'397	124'503	CHF	112.50	14'006'587.50	0.33 a)
CH0019107025	APG SGA SA	4'267	0	0	4'267	CHF	211.00	900'337.00	0.02 a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	13'714	3'359	2'123	14'950	CHF	364.00	5'441'800.00	0.13 a)
CH0021218067	EVOLVA HOLDING SA	2'047'717	0	2'047'717	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0021545667	VAUDOISE ASSURANCES HOL	3'173	0	150	3'023	CHF	450.00	1'360'350.00	0.03 a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	276'851	110'020	62'134	324'737	CHF	12.66	4'111'170.42	0.10 a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	1'523	110	44	1'589	CHF	1'690.00	2'685'410.00	0.06 a)
CH0023405456	AVOLTA AG	170'026	156'589	31'371	295'244	CHF	34.59	10'212'489.96	0.24 a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	35'804	17'555	7'863	45'496	CHF	30.95	1'408'101.20	0.03 a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	16'359	4'662	3'175	17'846	CHF	231.50	4'131'349.00	0.10 a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	57'955	13'439	9'193	62'201	CHF	1'269.00	78'933'069.00	1.88 a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	103'043	28'759	19'722	112'080	CHF	232.90	26'103'432.00	0.62 a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	54'074	11'641	7'405	58'310	CHF	224.80	13'108'088.00	0.31 a)
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	3'422	0	0	3'422	CHF	16.90	57'831.80	0.00 a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	142'395	29'108	18'528	152'975	CHF	297.60	45'525'360.00	1.08 a)
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	11'606	0	0	11'606	CHF	56.30	653'417.80	0.02 a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	7'801	1'708	1'513	7'996	CHF	526.00	4'205'896.00	0.10 a)
CH0025607331	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	449	0	449	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	421'290	83'833	54'287	450'836	CHF	77.98	35'156'191.28	0.84 a)
CH0027148649	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	119'620	1	119'621	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0028422100	BELLEVUE GROUP AG	19'962	0	0	19'962	CHF	22.00	439'164.00	0.01 a)
CH0029850754	ADDEX THERAPEUTICS LTD	1'502	0	0	1'502	CHF	0.06	94.03	0.00 a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	87'273	21'325	17'195	91'403	CHF	513.20	46'908'019.60	1.12 a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	48'475	12'634	9'463	51'646	CHF	64.20	3'315'673.20	0.08 a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	19'276	2'910	1'587	20'599	CHF	181.80	3'744'898.20	0.09 a)
CH0032816131	SF URBAN PROPERTIES AG	2'049	0	0	2'049	CHF	92.00	188'508.00	0.00 a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	19'098	6'211	3'544	21'765	CHF	84.30	1'834'789.50	0.04 a)
CH0038285679	ORASCOM DEVELOPMENT HOLDING	42'058	0	0	42'058	CHF	4.15	174'540.70	0.00 a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	44'527	11'120	5'823	49'824	CHF	103.40	5'151'801.60	0.12 a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	151'003	18'440	14'179	155'264	CHF	45.80	7'111'091.20	0.17 a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	7'063'626	1'331'871	1'041'528	7'353'969	CHF	91.76	674'800'195.44	16.07 a)
CH0039542854	MCH GROUP AG	12'889	0	0	12'889	CHF	4.56	58'773.84	0.00 a)
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	527	57	0	584	CHF	1'425.00	832'200.00	0.02 a)
CH0042615283	DOC MORRIS AG	32'638	7'923	3'086	37'475	CHF	82.75	3'101'056.25	0.07 a)
CH0043238366	ARYZTA AG	2'598'114	537'325	299'387	2'836'052	CHF	1.56	4'435'585.33	0.11 a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	13'068	0	0	13'068 CHF	16.85	220'195.80	0.01	a)
CH0100191136	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	5'068'790	0	5'068'790	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0100837282	KARDEX HOLDING AG-REG	15'882	2'530	1'442	16'970 CHF	235.00	3'987'950.00	0.09	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	544'311	123'200	106'146	561'365 CHF	47.28	26'541'337.20	0.63	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	354'446	216'629	354'446	216'629 CHF	0.35	75'820.15	0.00	a)
CH0106213793	SPEXIS AG	24'141	0	0	24'141 CHF	0.17	3'983.27	0.00	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	8'660'945	1'371'359	408'405	9'623'899 CHF	0.07	638'064.50	0.02	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	151'660	35'386	24'759	162'287 CHF	12.16	1'973'409.92	0.05	a)
CH0110303119	LECLANCHE SA-REG	194'047	0	0	194'047 CHF	0.59	114'487.73	0.00	a)
CH0111677362	ORIOR AG	21'362	2'619	1'050	22'931 CHF	64.70	1'483'635.70	0.04	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	48'143	4'559	0	52'702 CHF	8.39	442'169.78	0.01	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	14'141	0	0	14'141 CHF	28.35	400'897.35	0.01	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	94'752	22'116	15'496	101'372 CHF	64.95	6'584'111.40	0.16	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	741'264	154'419	95'450	800'233 CHF	106.60	85'304'837.80	2.03	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	7'962	3'703	2'240	9'425 CHF	129.00	1'215'825.00	0.03	a)
CH0130293662	BKW AG	52'059	12'665	7'816	56'908 CHF	124.00	7'056'592.00	0.17	a)
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	1'084	160	0	1'244 CHF	1'805.00	2'245'420.00	0.05	a)
CH0187624256	IVF HARTMANN HOLDING AG-REG	87	0	0	87 CHF	131.00	11'397.00	0.00	a)
CH0189396655	GLARNER KANTONALBANK	2'268	0	0	2'268 CHF	22.40	50'803.20	0.00	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	33'078	16'182	12'622	36'638 CHF	28.60	1'047'846.80	0.02	a)
CH0208062627	MEIER TOBLER GROUP AG	18'550	1'271	1'727	18'094 CHF	34.10	617'005.40	0.01	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1'340'047	308'935	169'400	1'479'582 CHF	140.60	208'029'229.20	4.95	a)
CH0212186248	NOVAVEST REAL ESTATE AG	582	0	0	582 CHF	35.00	20'370.00	0.00	a)
CH0212255803	BURKHALTER HOLDING AG	18'335	2'332	0	20'667 CHF	91.80	1'897'230.60	0.05	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	78'438	22'556	15'583	85'411 CHF	75.15	6'418'636.65	0.15	a)
CH0231351104	THURGAUER KANTONALBANK-CERT	9'953	0	0	9'953 CHF	122.00	1'214'266.00	0.03	a)
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	14'283	3'630	1'281	16'632 CHF	200.50	3'334'716.00	0.08	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	46'323	9'139	4'826	50'636 CHF	110.40	5'590'214.40	0.13	a)
CH0239518779	HIAG IMMOBILIEN AG	16'022	0	0	16'022 CHF	71.00	1'137'562.00	0.03	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	3'877	252	0	4'129 CHF	433.50	1'789'921.50	0.04	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	8'065'394	2'000'735	1'643'008	8'423'121 CHF	25.21	212'346'880.41	5.06	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	61'598	0	0	61'598 CHF	3.91	240'540.19	0.01	a)
CH0273774791	INTERSHOP HOLDING AG	3'482	443	186	3'739 CHF	615.00	2'299'485.00	0.05	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	26'713	7'467	6'597	27'583 CHF	54.00	1'489'482.00	0.04	a)
CH0276837694	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	114'402	28'958	15'203	128'157 CHF	13.66	1'750'624.62	0.04	a)
CH0284142913	PLAZZA AG-REG A	3'670	0	0	3'670 CHF	303.00	1'112'010.00	0.03	a)
CH0305285295	VARIA US PROPERTIES AG	3'750	0	0	3'750 CHF	36.40	136'500.00	0.00	a)
CH0305951201	WALLISER KANTONALBANK-REG	8'014	0	0	8'014 CHF	112.00	897'568.00	0.02	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	68'611	13'089	7'673	74'027 CHF	442.80	32'779'155.60	0.78	a)
CH0312309682	ZUEBLIN IMMOBILIEN HOLDI-REG	1'964	0	0	1'964 CHF	26.00	51'064.00	0.00	a)
CH0314029270	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	153'670	0	153'670	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	7'058	0	665	6'393 CHF	263.50	1'684'555.50	0.04	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	48'694	10'271	5'845	53'120 CHF	186.50	9'906'880.00	0.24	a)
CH0325094297	INVESTIS HOLDING SA	13'710	4'226	0	17'936 CHF	94.00	1'685'984.00	0.04	a)
CH0325814116	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	24'399	36'933	0	61'332 CHF	5.30	325'059.60	0.01	a)
CH0346177709	OBSEVA SA	170'912	0	170'912	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0350494719	BANQUE CANTONALE DE GENEV-BR	2'165	0	0	2'165 CHF	258.00	558'570.00	0.01	a)
CH0350665672	BANQUE CANTONALE DU JURA-REG	174	0	0	174 CHF	60.50	10'527.00	0.00	a)
CH0360674466	GALENICA AG	131'600	32'112	21'495	142'217 CHF	75.95	10'801'381.15	0.26	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	19'848	3'148	1'806	21'190 CHF	313.00	6'632'470.00	0.16	a)
CH0363463438	IDORSIA LTD	290'771	92'266	17'280	365'757 CHF	2.23	816'369.62	0.02	a)
CH0367427686	VALARTIS GROUP AG-BR	509	0	509	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0371153492	LANDIS + GYR GROUP AG	54'593	12'733	5'744	61'582 CHF	68.95	4'246'078.90	0.10	a)
CH0386200239	MEDARTIS HOLDING AG	10'177	0	0	10'177 CHF	72.60	738'850.20	0.02	a)
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	14'221	0	0	14'221 CHF	1.56	22'184.76	0.00	a)
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	29'016	2'443	1'526	29'933 CHF	66.80	1'999'524.40	0.05	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	394'450	96'966	50'686	440'730 CHF	255.50	112'606'515.00	2.68	a)
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	13'717	0	0	13'717 CHF	16.40	224'958.80	0.01	a)
CH0432492467	ALCON INC	1'283'366	250'471	157'536	1'376'301 CHF	75.18	103'470'309.18	2.46	a)
CH0435377954	SIG GROUP AG	894'615	158'403	98'906	954'112 CHF	17.50	16'696'960.00	0.40	a)
CH0453226893	ALUFLEXPACK AG	21'039	0	0	21'039 CHF	14.38	302'540.82	0.01	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	89'269	25'403	15'983	98'689	CHF	124.90	12'326'256.10	0.29 a)
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	16'778	1'912	972	17'718	CHF	126.60	2'243'098.80	0.05 a)
CH0478634105	AEVIS VICTORIA SA	16'575	0	0	16'575	CHF	16.00	265'200.00	0.01 a)
CH0493891243	ZUGER KANTONALBANK-BR	410	0	0	410	CHF	7'960.00	3'263'600.00	0.08 a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	288'229	58'178	35'911	310'496	CHF	16.50	5'123'184.00	0.12 a)
CH0516131684	EPIC SUISSE AG	5'577	0	0	5'577	CHF	69.20	385'928.40	0.01 a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	18'675	0	0	18'675	CHF	17.50	326'812.50	0.01 a)
CH0527044959	BERGBAHNEN ENGELB. TRUEB-REG	120	0	0	120	CHF	41.90	5'028.00	0.00 a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	42'817	4'177	0	46'994	CHF	111.00	5'216'334.00	0.12 a)
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	37'951	3'385	0	41'336	CHF	35.80	1'479'828.80	0.04 a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	74'041	27'138	18'792	82'387	CHF	105.90	8'724'783.30	0.21 a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	7'791	0	0	7'791	CHF	60.20	469'018.20	0.01 a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	7'851	1'242	178	8'915	CHF	238.50	2'126'227.50	0.05 a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	25'459	5'025	3'289	27'195	CHF	419.60	11'411'022.00	0.27 a)
CH1107979838	R&S GROUP HOLDING AG	0	20'000	0	20'000	CHF	10.60	212'000.00	0.01 a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	81'099	3'620	0	84'719	CHF	15.54	1'316'533.26	0.03 a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	40'063	8'243	3'975	44'331	CHF	16.10	713'729.10	0.02 a)
CH1129677105	MEDMIX AG	67'819	10'880	2'714	75'985	CHF	15.16	1'151'932.60	0.03 a)
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	206'848	41'279	25'640	222'487	CHF	65.50	14'572'898.50	0.35 a)
CH1169360919	ACCELLERON INDUSTRIES AG	199'286	82'965	18'173	264'078	CHF	29.80	7'869'524.40	0.19 a)
CH1173567111	GURIT HOLDING AG-BR	9'260	565	0	9'825	CHF	64.70	635'677.50	0.02 a)
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	289'792	66'599	46'298	310'093	CHF	139.60	43'288'982.80	1.03 a)
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	79'681	15'211	7'575	87'317	CHF	70.00	6'112'190.00	0.15 a)
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	1'265'537	75'436	1'190'101	CHF	27.46	32'680'173.46	0.78 a)
CH1248667003	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG	0	3'281	289	2'992	CHF	441.00	1'319'472.00	0.03 a)
CH1251125998	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	0	12'671	0	12'671	CHF	1.52	19'259.92	0.00 a)
CH1252930610	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	0	60'845	0	60'845	CHF	70.80	4'307'826.00	0.10 a)
CH1256740924	SGS SA-REG	0	467'114	50'451	416'663	CHF	84.80	35'333'022.40	0.84 a)
CH1260041939	OBSEVA SA	0	170'912	0	170'912	CHF	0.01	1'794.58	0.00 a)
CH1261338102	PHOENIX MECANO AG - REG	0	1'926	0	1'926	CHF	464.00	893'664.00	0.02 a)
CH1262055788	EVOLVA HOLDING SA	0	8'190	0	8'190	CHF	0.63	5'159.70	0.00 a)
CH1263676327	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	0	11'225	0	11'225	CHF	52.80	592'680.00	0.01 a)
CH1276028821	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	0	27'139	0	27'139	CHF	10.40	282'245.60	0.01 a)
CH1276062754	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	0	3'073	0	3'073	CHF	4.30	13'213.90	0.00 a)
CH1278877563	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-RG	0	555	0	555	CHF	314.00	174'270.00	0.00 a)
CH1287398072	VON ROLL HOLDING AG-NEW	0	135'937	135'937	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1289177243	GAM HOLDING AG-TEND	0	708'892	708'892	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1298733861	SCHAFFNER HOLDING AG	0	1'003	1'003	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1300003089	CREALOGIX HOLDING AG-NEW	0	1'528	1'528	0	CHF	0.00	0.00	0.00
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	13'323	0	0	13'323	CHF	21.20	282'447.60	0.01 a)
VGG794831062	SEALSQ CORP	0	1'582	1'582	0	USD	0.00	0.00	0.00
CH							4'165'755'778.63	99.22	
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	48'846	6'726	0	55'572	CHF	8.20	455'690.40	0.01 a)
IT							455'690.40	0.01	
LI0315487269	VP BANK AG-A	8'821	0	0	8'821	CHF	96.40	850'344.40	0.02 a)
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	32'615	0	0	32'615	CHF	71.10	2'318'926.50	0.06 a)
LI							3'169'270.90	0.08	
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	25'304	4'809	1'457	28'656	CHF	65.90	1'888'430.40	0.04 a)
NL							1'888'430.40	0.04	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
CH1234292360	ORASCOM DEVELOPMENT-RTS	0	42'058	42'058	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1252979377	LUZERNER KANTONALBANK AG	0	44'415	44'415	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1291444144	AUTONEUM HOLDING AG-RIGHTS	0	8'989	8'989	0	CHF	0.00	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1305590544	AMS-OSRAM AG-RTS	0	755'662	755'662	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Futures							0.00	0.00	
03/23	SWISS MKT IX FUTR MAR23	120	81	201	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/23	SWISS MID CAP FUT MAR23	167	0	167	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MID CAP FUT JUN23	0	167	167	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MKT IX FUTR JUN23	0	781	781	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MKT IX FUTR SEP23	0	682	682	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MID CAP FUT SEP23	0	167	167	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	0	621	621	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MID CAP FUT DEC23	0	167	167	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	0	396	216	180 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	SWISS MID CAP FUT MAR24	0	167	0	167 CHF	0.00	0.00	0.00	a)

Vermögensaufstellung		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		10'574'659.80	0.25
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte		4'176'200'304.05	99.47
Sonstige Vermögenswerte		11'634'645.34	0.28
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'198'409'609.19	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-100'818.35	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'198'308'790.84	

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);	4'176'200'304.05	99.47
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		Kurswert CHF	in % 7)
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte		435'441'798.65	10.37
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	20 CHF	3'720.00
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	2'900 CHF	16.95
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	484'084 CHF	0.09
CH0006089921	PRIVATE EQUITY HLDG-REG	1'000 CHF	68.00
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	70'189 CHF	505.40
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	9'737 CHF	1'242.00
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	3'677 CHF	164.40
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	100'733 CHF	231.95
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	55'613 CHF	40.45
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	9'025 CHF	208.60
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	135'554 CHF	272.30
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	56'701 CHF	641.60
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	23'213 CHF	112.50
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	200 CHF	364.00
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	8'210 CHF	1'269.00
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5'000 CHF	232.90
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	247 CHF	16.90
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	152'248 CHF	297.60
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	2'000 CHF	56.30
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	448'520 CHF	77.98
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	90'998 CHF	513.20
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	600 CHF	84.30

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 29.02.2024 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
CH0038388911	SULZER AG-REG	6'156 CHF	103.40	636'530.40	0.02	
CH0039542854	MCH GROUP AG	8'851 CHF	4.56	40'360.56	0.00	
CH0042615283	DOCMORRIS AG	12'064 CHF	82.75	998'296.00	0.02	
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	9'623'897 CHF	0.07	638'064.37	0.02	
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	35'750 CHF	8.39	299'942.50	0.01	
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	6'250 CHF	129.00	806'250.00	0.02	
CH0239229302	SFS GROUP AG	1'100 CHF	110.40	121'440.00	0.00	
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	1'031 CHF	3.91	4'026.06	0.00	
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	28'529 CHF	66.80	1'905'737.20	0.05	
CH0418792922	SIKA AG-REG	371'643 CHF	255.50	94'954'786.50	2.26	
CH0432492467	ALCON INC	473'519 CHF	75.18	35'599'158.42	0.85	
CH0435377954	SIG GROUP AG	159'347 CHF	17.50	2'788'572.50	0.07	
CH0478634105	AEVIS VICTORIA SA	5'000 CHF	16.00	80'000.00	0.00	
CH1107979838	R&S GROUP HOLDING AG	5'836 CHF	10.60	61'861.60	0.00	
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	9'901 CHF	16.10	159'406.10	0.00	
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	73'191 CHF	70.00	5'123'370.00	0.12	
CH1251125998	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	8'670 CHF	1.52	13'178.40	0.00	
CH1252930610	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	2'800 CHF	70.80	198'240.00	0.00	
CH1276028821	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	17'138 CHF	10.40	178'235.20	0.00	
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	4'167 CHF	21.20	88'340.40	0.00	
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	2'000 CHF	65.90	131'800.00	0.00	

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.95288338
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	744'438.35	0.160
Bond	CHF	463'892'876.94	99.840
Total	CHF	464'637'315.29	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	24'868'705.10	0.592
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.003
FA CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.003
GT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.003
MT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.003
NT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.003

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

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	435'441'798.65
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.150	0.400	0.100	0.050	3.000
FA CHF	0.150	0.500	0.050	0.100	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
MT CHF	-	-	-	-	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

SPI® 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 2023 / 2024

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

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	4.00000	1.40000	2.60000

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

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

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	6.015	2.105	3.910
GT CHF	Nein	CHF	4.197	1.468	2.729
MT CHF	Nein	CHF	3.083	1.079	2.004
NT CHF	Nein	CHF	6.464	2.262	4.202

13 Ausschüttung des Kapitalgewinns 2023 / 2024

Ex-Tag: 18.06.2024 **Ausschüttung des Kapitalgewinns an Anteilscheininhaber**
Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Währung	Netto
FA CHF	CHF	0.20000

14 Fussnoten

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

15 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 Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

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

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

mit den Teilvermögen

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

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

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Begründung für die Vereinigung

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie der Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf www.fundinfo.com veröffentlichen.

7 Kosten

Dem übertragenden Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	21. Juli 2023 bis 26. Juli 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigung führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigung löst auf Ebene der an der Vereinigung beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

II Änderungen im Fondsvertrag

Im Hinblick auf die Vereinigung erfolgt in der Anlagepolitik eine Angleichung der teilvermögensspezifischen Bestimmungen des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens.

In § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF nach bildet. Bis anhin war der FTSE Non-CHF World Government Bond Index der massgebende Referenzindex.

Teil 2 – Repositionierungen bei Teilvermögen, Umbenennung der Bezeichnung bei einem Teilvermögen und Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

1 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll neu als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF (neu beantragte Bezeichnung Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I), vgl. nachstehende Ziff. 3 dieser Veröffentlichung) dienen. Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 21, § 15 Ziff. 13 und 22 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen des Teilvermögens bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds fungiert, soll gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des Zielfonds erwerben können (vgl. dazu die erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages).

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgebliche investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anlegerinnen und Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF als investierende kollektive Kapitalanlage

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll neu in den Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren können. In diesem Zusammenhang wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren darf (vgl. die Anpassungen in § 8 Ziff. 21 sowie § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages).

Betreffend die weiteren für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF aufgenommenen Anpassungen in § 15 Ziff. 13, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1, welche zum Ziel haben, dass das Teilvermögen in den Zielfonds investieren kann, wird auf die obenstehenden Ausführungen in Ziff. 1 dieser Veröffentlichung verwiesen.

In § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages wird zudem eine neue Bestimmung aufgenommen, wonach die Fondsleitung für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien desselben Zielfonds angelegt werden darf.

3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF sowie entsprechende Anpassung in der Anlagepolitik

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 23 und 27 (nach Vereinigung neue Ziff. 26), § 15 Ziff. 3, 13 und 22, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages)

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird auch der Referenzindex entsprechend in § 8 Ziff. 26 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index.

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

Per 25. Juli 2023 werden Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt (vgl. unsere Ausführungen in Teil 1, I, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)	
DT CHF	FA CHF	25. Juli 2023

Im Nachgang zur Vereinigung der Teilvermögen werden per 10. August 2023 die Anteile der Klasse DTH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FAH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
FAH1 CHF	DTH1 CHF	10. August 2023

Die jeweilige übertragende Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens wird gemäss der vorstehenden Tabelle, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, mit der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens vereinigt. Das Umtauschverhältnis für den Umtausch von Anteilen der jeweiligen übertragenden Anteilsklasse in Anteile der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse wird jeweils nach Durchführung der Vereinigung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds (www.fundinfo.com) veröffentlicht.

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

Für das nachgenannte Teilvermögen sind die folgenden Anteilsklassen im angepassten Fondsvertrag nicht mehr vorgesehen (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages):

Teilvermögen	Anteilsklassen
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD

* * *

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{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, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

zwei Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

1. des Vollzuges der Vereinigung;
2. der Umtauschverhältnisse; und
3. der Bestätigung der Prüfgesellschaft.

1 Vollzug der Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 25. Juli 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 25. Juli 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens auch für das übertragende Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnisse

Die Fondsleitung ermittelte das Umtauschverhältnis, welches von der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft Ernst & Young AG geprüft und für korrekt befunden wurde.

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 25. Juli 2023:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)			Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)		
	ISIN	NAV pro Anteil		ISIN	NAV pro Anteil
FA CHF	CH0315621307	70.93	FA CHF	CH1270020246	70.93
DT CHF	CH0117045291	79.46	FA CHF	CH1270020246	70.93
GT CHF	CH0342828479	76.10	GT CHF	CH1270020279	76.10
NT CHF	CH0117045283	80.75	NT CHF	CH1270020295	80.75

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergibt sich das folgende Umtauschverhältnis jeweils aus Sicht des übertragenden Teilvermögens (1 Anteil des übertragenden Teilvermögens ↔ Anzahl Anteile am übernehmenden Teilvermögen):

Swisscanto (CH) Pension Equity Fund Responsible Europe ex CH (übertragendes Teilvermögen)	
Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
FA CHF	1 ↔ 1.0000000000
DT CHF	1 ↔ 1.1202372991
GT CHF	1 ↔ 1.0000000000
NT CHF	1 ↔ 1.0000000000

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 8. August 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) per 25. Juli 2023 geprüft.

Für die Berechnung der Umtauschverhältnisse ist die Fondsleitung verantwortlich, während unsere Aufgabe darin besteht, die Berechnung der Umtauschverhältnisse zu prüfen und zu beurteilen.

Unsere Prüfung erfolgte nach den Schweizer Prüfungsstandards, wonach eine Prüfung so zu planen und durchzuführen ist, dass wesentliche Fehlaussagen in der Berechnung der Umtauschverhältnisse mit angemessener Sicherheit erkannt werden. Wir prüften die Grundlagen der Berechnung der Umtauschverhältnisse mittels Analysen und Erhebungen auf der Basis von Stichproben. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine ausreichende Grundlage für unser Urteil bildet.

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung der oben erwähnten Teilvermögen korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt."

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

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

Zürich, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

ein Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

Die mit Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds angekündigte Vereinigung von Anteilsklassen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds wurde vollzogen.

Nachstehend wird für das genannte Teilvermögen das Umtauschverhältnis für die Vereinigung der übertragenden Anteilsklasse mit der übernehmenden Anteilsklasse basierend auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 10. August 2023 aufgeführt.

Anteilsklasse DTH1 CHF (übertragende)			Anteilsklasse FAH1 CHF (übernehmende)			
Anteilsklasse)	ISIN	NAV pro Anteil	Umtauschverhältnis	Anteilsklasse)	ISIN	NAV pro Anteil
DTH1 CHF	CH0117045325	93.42	1 ↔ 1.2900884308	FAH1 CHF	CH0315621315	72.41

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass die Frist zur Erhebung von Einwendungen gegen die oben erwähnte Vereinigung von Anteilsklassen abgelaufen ist und Einwendungen gegen diese Vereinigung nicht mehr möglich sind.

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund II**

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, neun Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit einem Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V (nachfolgend auch "der / die Umbrella-Fonds") zu vereinigen und den Fondsvertrag des übertragenden Umbrella-Fonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu den Vereinigungen und zu den in Zusammenhang mit den Vereinigungen erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgenden Vereinigungen durchzuführen:

Übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Stichtag der Vereinigungen (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	22. November 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.		

2 Gründe für die Vereinigungen

Mit den Vereinigungen soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anleger ist. Die Vereinigungen erlauben das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglichen ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

Die Voraussetzungen für Vereinigungen sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 der Fondsverträge der Umbrella-Fonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist bei den übertragenden Teilvermögen sowie beim übernehmenden Teilvermögen in § 25 des jeweiligen Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Am gleichen Tag werden die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen werden mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum die übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V vereinigt. Die Vereinigungen erfolgen durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen werden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anleger und Anlegerinnen der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V. Die Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen entsprechen dabei jeweils inhaltlich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigungen überführt werden.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR

Am 23. November 2023 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V bzw. übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II aufgrund der Schlusskurse vom 22. November 2023 durchgeführt. Am 23. November 2023 (Bewertungstag), erfolgen die Vereinigungen durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf 22. November 2023 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 8. August 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigungen

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigungen überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigungen durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigungen mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie den Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen auf www.fundinfo.com veröffentlichen.

7 Kosten

Den übertragenden (und dem übernehmenden) Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen wird die Ausgabe bzw. Rückzahlung von Anteilen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und des übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigungen führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigungen lösen auf Ebene der an den Vereinigungen beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

Im Hinblick auf die Vereinigungen muss der Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II angepasst werden.

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 25 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II sowie des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen der übertragenden Teilvermögen für die Vereinigungen mit dem übernehmenden Teilvermögen in Einklang mit den betreffenden Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2, 2.3 und 2.4 nachstehend).
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend).
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4 nachstehend).
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend).
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend).

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigungen und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens, bedarf es einer Anpassung der Bestimmungen der Anlagepolitik des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen lautet neu wie folgt:

"Anlagen in OTC-Derivate (OTC-Geschäften) sind nur zulässig, wenn (i) die Gegenpartei ein beaufsichtigter, auf dieses Geschäft spezialisierter Finanzintermediär ist, und (ii) die OTC-Derivate täglich handelbar sind oder eine Rückgabe an den Emittenten jederzeit möglich ist. Zudem sind sie zuverlässig und nachvollziehbar bewertbar. Derivate können gemäss § 12 eingesetzt werden.

Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen (Zielfonds). Als "andere kollektive Kapitalanlagen" im Sinne dieses Fondsvertrages gelten:

- *inländische kollektive Kapitalanlagen der Art "Effektenfonds", "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"), wenn deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen.*
- *ausländische offene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und bei denen die Auszahlung von Rücknahme-*

oder Rückkaufsbefugnissen keinen Beschränkungen unterliegt. Es handelt sich um kollektive Kapitalanlagen, (i) deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen; (ii) für welche in Bezug auf Zweck, Organisation, Anlagepolitik, Anlegerschutz, Risikoverteilung, getrennte Verwahrung des Fondsvermögens, Kreditaufnahme, Kreditgewährung, Leerverkäufe von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, Ausgabe und Rücknahme der Anteile bzw. Aktien und Inhalt der Halbjahres- und Jahresberichte gleichwertige Bestimmungen gelten wie für Effektenfonds oder Fonds der Art „Übrige Fonds für traditionelle Anlagen“ und (iii) welche im Sitzstaat als kollektive Kapitalanlagen zugelassen sind und dort einer dem Anlegerschutz dienenden, der schweizerischen gleichwertigen Aufsicht unterstehen, und die internationale Amtshilfe gewährleistet ist.

- ausländische geschlossene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und deren Dokumente die Anlagen in andere Zielfonds ihrerseits insgesamt auf 30% begrenzen. Solche geschlossene kollektive Kapitalanlagen unterliegen in ihrem Heimatstaat überwiegend keiner Aufsicht. Soweit solche kollektive Kapitalanlagen in ihrem Heimatstaat einer Aufsicht unterliegen, wird diese nicht notwendigerweise nach der Praxis der Schweizer Aufsichtsbehörde als "gleichwertig" eingestuft. Zudem wird die internationale Amtshilfe nicht zwingend gewährleistet. Die Anlagepolitik der geschlossenen kollektiven Kapitalanlagen muss derjenigen eines Effektenfonds oder eines übrigen Fonds für traditionelle Anlagen gleichwertig sein (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"). Ihre Anteile bzw. Aktien müssen an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.
- Beteiligungen an Immobilienfonds (einschliesslich Real Estate Investment Trusts, REITs), die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.

Die Rücknahmefrequenz oder Liquidität der Zielfonds hat grundsätzlich derjenigen des betreffenden Teilvermögens zu entsprechen. Die Verwendung von Zielfonds darf nicht zu einer Veränderung des Anlagecharakters eines Teilvermögens führen. Nach ihrer Rechtsform kann es sich bei den Zielfonds um vertragsrechtliche Anlagefonds, kollektive Kapitalanlagen in gesellschaftsrechtlicher Form, liechtensteinische Treuunternehmen, Business Trusts nach dem Recht US-amerikanischer Gliedstaaten, Investmentvereine oder um Unit Trusts handeln.

Die Fondsleitung kann Anteile bzw. Aktien von offenen kollektiven Kapitalanlagen sowohl aus Ausgabe wie auf dem Sekundärmarkt erwerben und Anteile bzw. Aktien sowohl zurückgeben wie auf dem Sekundärmarkt veräussern.

Die Fondsleitung darf unter Vorbehalt von § 20 Ziff. 6 Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) erwerben, die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist. "

Die teilvermögensspezifische Anlagepolitik in § 8 Ziff. 4 bis 12 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird wie folgt angepasst:

"Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE EMU Government Bond Index nach. Dabei kann die Fondsleitung, statt in sämtliche Titel des Referenzindex zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimized Sampling).

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{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 Teil II Ziff. 2 und 5 der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge erstreckt.

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH
Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

betreffend

Einstellung von Zeichnungen und Aufschub von Rückzahlungen von Anteilen des folgenden Teilvermögens des oben genannten Umbrella-Fonds

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

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) investiert einen wesentlichen Anteil seines Fondsvermögens in neun Teilvermögen (Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.) des Umbrella-Fonds *Swisscanto (CH) Index Fund II*, bei welchen im Rahmen der Vereinigung mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während einzelner Tage Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden (vgl. die Publikation vom 18. September 2023 betreffend den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Dies hat zur Folge, dass beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während des folgenden Zeitraums Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden:

Teilvermögen	Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	20. November 2023 bis 24. November 2023

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

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

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

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

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

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

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

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

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

2 Gating-Verfahren

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{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 dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser

Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 23. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die Teilvermögen

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

Mit Veröffentlichung vom 23. November 2023 wurden, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, von der Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, diverse Anpassungen des Fondsvertrages beantragt.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist unter anderem die **Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH**. Diese Anpassung beabsichtigt, dass die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, gestrichen werden soll (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 der Veröffentlichung vom 23. November 2023).

In Zusammenhang mit der geplanten Änderung wird in der gleichen Bestimmung (in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages) zudem neu die Regelung ergänzt, dass Investitionen in Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich