

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE

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
GT CHF	122424489	CHF
NT CHF	122424481	CHF
ST CHF	122424485	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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	14
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	15
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
7	Pauschale Verwaltungskommission	16
8	Benchmark	16
9	TER	16
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	16
11	Fussnoten	17
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18
13	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

	<i>Lancierung</i>
von	31.10.2022
bis	29.02.2024
<hr/>	
Konsolidiert	CHF
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'126'163'631.69
<hr/>	
Klasse GT CHF	CHF
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'972'669.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	24'299.598
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	122.3341
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR	128.3831
Thesaurierung je Anteil	3.48
Total Expense Ratio (TER)	0.15 %
<hr/>	
Klasse NT CHF	CHF
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	193'974'716.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	1'582'464.884
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	122.5776
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR	128.6386
Thesaurierung je Anteil	3.71
Total Expense Ratio (TER)	0.00 %
<hr/>	
Klasse ST CHF	CHF
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	929'216'246.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	7'580.642
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	122'577.5134
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR	128'638.5263
Thesaurierung je Anteil	3'711.14
Total Expense Ratio (TER)	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 GT CHF (Lancierung 31.10.2022)	22.33 %	10.46 %	3.79 %	-
Klasse NT CHF (Lancierung 31.10.2022)	22.58 %	10.62 %	3.82 %	-
Klasse ST CHF (Lancierung 31.10.2022)	22.58 %	10.62 %	3.82 %	-
Benchmark	21.67 %	9.77 %	3.72 %	-
Tracking Error 33)	0.64 %	0.71 %	0.47 %	-

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.

Die Performance für das Geschäftsjahr 2023 / 2024 wird ab der Lancierung 31.10.2022 gerechnet.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse GT CHF (Lancierung 31.10.2022)	0.66 %
Klasse NT CHF (Lancierung 31.10.2022)	0.91 %
Klasse ST CHF (Lancierung 31.10.2022)	0.91 %

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
Bankguthaben auf Sicht	8'901'762.28
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'115'793'944.74
Sonstige Vermögenswerte	1'468'240.72
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'126'163'947.74
Andere Verbindlichkeiten	-316.05
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'126'163'631.69

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	<i>Lancierung</i> 31.10.2022 29.02.2024
Klasse GT CHF		
Ausgegebene Anteile		116'203.277
Zurückgenommene Anteile		-91'903.679
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		24'299.598

	von bis	<i>Lancierung</i> 31.10.2022 29.02.2024
Klasse NT CHF		
Ausgegebene Anteile		804'846.962
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		928'329.717
Zurückgenommene Anteile		-150'711.795
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'582'464.884

	von bis	<i>Lancierung</i> 31.10.2022 29.02.2024
Klasse ST CHF		
Ausgegebene Anteile		1'773.825
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		5'900.824
Zurückgenommene Anteile		-94.007
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'580.642

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	06.03.2023	105'668'884.99	907'853.527
Klasse NT CHF	22.11.2023	2'321'948.76	20'476.190
Klasse ST CHF	20.03.2023	650'969'867.16	5'900.824

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	<i>Lancierung</i> 31.10.2022 29.02.2024
Konsolidiert		
Saldo aus dem Anteilverkehr		1'011'021'910.39
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		115'141'721.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'126'163'631.69

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	<i>Lancierung</i> 31.10.2022 29.02.2024
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		228'745.37
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		23'219'513.41
Erträge der Gratisaktien		882'985.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		10'857'259.89
Total Ertrag		35'188'503.90
Aufwand		
Passivzinsen		-57.82
Reglementarische Vergütungen		-13'320.11
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'084'822.86
Total Aufwand		-1'098'200.79
Nettoertrag / Verlust		34'090'303.11
Realisierter Erfolg		
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-10'094'706.55
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		609'347.69
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		785'076.23
Realisierter Erfolg		25'390'020.48
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		89'751'700.82
Gesamterfolg		115'141'721.30

Verwendung des Erfolges

Klasse GT CHF	29.02.2024
Nettoertrag	84'673.19
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	84'673.19
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	29'635.62
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	55'037.57
Total	84'673.19
Klasse NT CHF	29.02.2024
Nettoertrag	5'872'732.09
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5'872'732.09
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'055'456.23
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'817'275.86
Total	5'872'732.09
Klasse ST CHF	29.02.2024
Nettoertrag	28'132'897.83
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	28'132'897.83
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	9'846'514.24
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	18'286'383.59
Total	28'132'897.83

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	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							1'115'793'944.74	99.08	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							1'115'793'944.74	99.08	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	0	67'553	67'553	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT0000746409	VERBUND AG	0	18'575	18'575	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT							0.00	0.00	
BE0003470755	SOLVAY SA	0	22'811	22'811	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003565737	KBC GROUP NV	0	72'763	14'282	58'481 EUR	64.90	3'616'589.68	0.32 a)	
BE0003604155	LOTUS BAKERIES	0	97	0	97 EUR	8'700.00	804'138.28	0.07 a)	
BE0003739530	UCB SA	0	36'192	36'192	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003810273	PROXIMUS	0	302	302	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974259880	D'IETEREN GROUP	0	7'846	7'846	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	0	185'829	0	185'829 EUR	55.72	9'866'527.93	0.88 a)	
BE0974320526	UMICORE	0	74'758	74'758	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974349814	WAREHOUSES DE PAUW SCA	0	1'204	1'204	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974464977	SYENSQO SA	0	25'335	0	25'335 EUR	82.61	1'994'312.83	0.18 a)	
BE							16'281'568.72	1.45	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	555'002	203'908	351'094 USD	6.00	1'855'423.40	0.16 a)	
BM							1'855'423.40	0.16	
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	0	85'545	0	85'545 GBP	2'465.00	2'348'761.58	0.21 a)	
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	31'914	11'565	20'349 EUR	99.00	1'919'632.17	0.17 a)	
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	0	211'797	0	211'797 EUR	41.73	8'420'849.43	0.75 a)	
CH							12'689'243.18	1.13	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	0	432'588	0	432'588 EUR	12.36	5'095'689.53	0.45 a)	
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	0	53'944	0	53'944 EUR	109.22	5'614'163.69	0.50 a)	
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	0	21'142	0	21'142 EUR	101.30	2'040'775.66	0.18 a)	
DE0005200000	BEIERSDORF AG	0	23'996	0	23'996 EUR	132.55	3'030'807.39	0.27 a)	
DE0005313704	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	0	23'612	12'526	11'086 EUR	113.75	1'201'616.91	0.11 a)	
DE0005439004	CONTINENTAL AG	0	8'511	1'017	7'494 EUR	74.08	528'998.47	0.05 a)	
DE0005552004	DHL GROUP	0	171'261	0	171'261 EUR	42.91	7'002'558.44	0.62 a)	
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	0	590'198	590'198	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	0	103'498	16'153	87'345 EUR	25.88	2'153'982.02	0.19 a)	
DE0005785802	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	0	43'814	1'800	42'014 EUR	35.38	1'416'418.57	0.13 a)	
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	0	38'245	38'245	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006047004	HEIDELBERG MATERIALS AG	0	7'617	7'617	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	8'511	0	8'511 EUR	62.40	506'063.40	0.04 a)	
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	0	33'143	0	33'143 EUR	69.56	2'196'803.15	0.20 a)	
DE0006062144	COVESTRO AG	0	54'853	54'853	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006599905	MERCK KGAA	0	30'237	737	29'500 EUR	157.80	4'435'767.42	0.39 a)	
DE0006602006	GEA GROUP AG	0	35'918	0	35'918 EUR	37.27	1'275'590.54	0.11 a)	
DE0007010803	RATIONAL AG	0	851	442	409 EUR	760.00	296'194.27	0.03 a)	
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	0	138'682	1'595	137'087 EUR	73.64	9'619'440.32	0.85 a)	
DE0007164600	SAP SE	0	165'765	0	165'765 EUR	172.88	27'307'210.87	2.42 a)	
DE0007165631	SARTORIUS AG-VORZUG	0	7'720	1'356	6'364 EUR	349.80	2'121'239.61	0.19 a)	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	0	112'454	0	112'454 EUR	182.94	19'603'035.88	1.74 a)	
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	0	12'241	0	12'241 EUR	237.30	2'767'925.45	0.25 a)	
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	69'896	0	69'896 EUR	253.85	16'907'104.72	1.50 a)	
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0	28'838	0	28'838 EUR	430.40	11'827'069.59	1.05 a)	
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES AG	0	19'239	3'196	16'043 EUR	222.30	3'398'324.12	0.30 a)	
DE000A12DM80	SCOUT24 SE	0	23'553	1'726	21'827 EUR	67.20	1'397'664.95	0.12 a)	
DE000A1DAH00	BRENNTAG SE	0	39'294	0	39'294 EUR	84.38	3'159'406.55	0.28 a)	
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	0	26'922	97	26'825 EUR	187.12	4'782'992.41	0.42 a)	
DE000A1ML7J1	VONOVIA SE	0	151'460	12'471	138'989 EUR	25.80	3'416'959.95	0.30 a)	
DE000BASF111	BASF SE	0	173'303	0	173'303 EUR	47.08	7'773'850.10	0.69 a)	
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	0	350'188	86'406	263'782 EUR	10.70	2'688'225.51	0.24 a)	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000DTR0CK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	0	142'584	0	142'584	EUR	37.78	5'133'014.60	0.46 a)
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	0	200'815	35'939	164'876	EUR	14.21	2'231'713.46	0.20 a)
DE000EVNKO13	EVONIK INDUSTRIES AG	0	90'521	20'574	69'947	EUR	17.06	1'137'071.75	0.10 a)
DE000KXB1006	KNORR-BREMSE AG	0	10'519	4'223	6'296	EUR	64.68	388'038.20	0.03 a)
DE000KGX8881	KION GROUP AG	0	481	481	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	0	25'086	9'160	15'926	EUR	68.02	1'032'245.72	0.09 a)
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	0	25'250	11'411	13'839	EUR	86.34	1'138'561.53	0.10 a)
DE000SHL1006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	0	81'695	0	81'695	EUR	55.50	4'320'442.33	0.38 a)
DE000SYM9999	SYMRISE AG	0	34'978	0	34'978	EUR	94.56	3'151'680.53	0.28 a)
DE000TLX1005	TALANX AG	0	17'054	0	17'054	EUR	66.00	1'072'531.23	0.10 a)
DE000WCH8881	WACKER CHEMIE AG	0	6'969	6'969	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	0	56'100	13'433	42'667	EUR	19.52	793'618.30	0.07 a)
DE								173'964'797.14	15.45
DK0010181759	CARLSBERG A/S-B	0	22'287	6'140	16'147	DKK	961.00	1'983'614.14	0.18 a)
DK0010219153	ROCKWOOL A/S-B SHS	0	1'363	1'200	163	DKK	2'205.00	45'944.99	0.00 a)
DK0010244425	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0	100	0	100	DKK	9'350.00	119'523.57	0.01 a)
DK0010244508	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0	579	0	579	DKK	9'746.00	721'351.49	0.06 a)
DK0010272202	GENMAB A/S	0	12'035	0	12'035	DKK	1'930.00	2'969'240.43	0.26 a)
DK0010274414	DANSKE BANK A/S	0	235'491	104'767	130'724	DKK	202.50	3'383'937.38	0.30 a)
DK0060079531	DSV A/S	0	28'773	28'773	0	DKK	0.00	0.00	0.00
DK0060094928	ORSTED A/S	0	45'087	16'783	28'304	DKK	386.70	1'399'148.95	0.12 a)
DK0060252690	PANDORA A/S	0	15'518	15'518	0	DKK	0.00	0.00	0.00
DK0060336014	NOVOZYMES A/S-B SHARES	0	66'449	0	66'449	DKK	388.80	3'302'605.26	0.29 a)
DK0060448595	COLOPLAST-B	0	25'385	3'322	22'063	DKK	915.60	2'582'333.39	0.23 a)
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	0	218'538	218'538	0	DKK	0.00	0.00	0.00
DK0060738599	WILLIAM DEMANT HOLDING	0	22'207	1'184	21'023	DKK	345.10	927'431.01	0.08 a)
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	0	206'631	23'720	182'911	DKK	191.94	4'487'942.42	0.40 a)
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	495'409	0	495'409	DKK	819.70	51'911'166.62	4.61 a)
DK								73'834'239.65	6.56
ES0105046009	AENA SME SA	0	17'521	4'250	13'271	EUR	175.15	2'214'897.04	0.20 a)
ES0105066007	CELLNEX TELECOM SA	0	61'621	2'645	58'976	EUR	33.27	1'869'682.51	0.17 a)
ES0105563003	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	0	61'633	61'633	0	EUR	0.00	0.00	0.00
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	0	82'088	0	82'088	EUR	54.38	4'253'619.42	0.38 a)
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	0	2'971'338	491'547	2'479'791	EUR	3.85	9'086'730.49	0.81 a)
ES0116870314	NATURGY ENERGY GROUP SA	0	35'400	35'400	0	EUR	0.00	0.00	0.00
ES0125220311	ACCIONA SA	0	9'849	0	9'849	EUR	103.45	970'872.91	0.09 a)
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	0	211'940	0	211'940	EUR	12.60	2'543'611.93	0.23 a)
ES0130670112	ENDESA SA	0	71'108	39'318	31'790	EUR	16.64	504'061.59	0.04 a)
ES0130960018	ENAGAS SA	0	149'695	0	149'695	EUR	13.35	1'903'555.86	0.17 a)
ES0140609019	CAIXABANK SA	0	567'625	0	567'625	EUR	4.17	2'255'471.39	0.20 a)
ES0143416115	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	0	3'320	3'320	0	EUR	0.00	0.00	0.00
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	0	1'058'178	45'183	1'012'995	EUR	10.62	10'251'125.98	0.91 a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	0	167'464	0	167'464	EUR	41.01	6'544'115.89	0.58 a)
ES0167050915	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	0	79'238	11'565	67'673	EUR	37.94	2'446'541.06	0.22 a)
ES0171996087	GRIFOLS SA	0	62'813	0	62'813	EUR	7.58	453'928.67	0.04 a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	0	107'171	78'016	29'155	EUR	14.70	408'385.33	0.04 a)
ES0178430E18	TELEFONICA SA	0	1'050'009	0	1'050'009	EUR	3.79	3'795'033.52	0.34 a)
ES								49'501'633.59	4.40
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	0	38'556	38'556	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FI0009000681	NOKIA OYJ	0	1'202'347	35'666	1'166'681	EUR	3.26	3'623'621.79	0.32 a)
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	0	76'859	0	76'859	EUR	14.30	1'046'932.41	0.09 a)
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	0	133'516	0	133'516	EUR	11.68	1'485'990.07	0.13 a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	0	100'215	0	100'215	EUR	30.93	2'953'604.92	0.26 a)
FI0009007132	FORTUM OYJ	0	57'861	57'861	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FI0009007884	ELISA OYJ	0	19'098	0	19'098	EUR	41.66	758'135.63	0.07 a)
FI0009013296	NESTE OYJ	0	74'243	74'243	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FI0009013403	KONE OYJ-B	0	46'949	7'243	39'706	EUR	45.22	1'710'907.18	0.15 a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	0	58'072	9'422	48'650	EUR	36.40	1'687'423.06	0.15 a)
FI0009014575	METSO OUTOTEC OYJ	0	148'331	0	148'331	EUR	9.87	1'395'329.65	0.12 a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	0	705'379	1'891	703'488	SEK	125.86	7'534'644.24	0.67 a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FI							22'196'588.95	1.97	
FR0000039299	BOLLORE SE	0	296'214	296'214	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	0	243'990	0	243'990 EUR	12.52	2'910'825.08	0.26	a)
FR0000051807	TELEPERFORMANCE	0	9'933	0	9'933 EUR	114.55	1'084'214.67	0.10	a)
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	0	4'532	0	4'532 EUR	2'313.00	9'988'615.28	0.89	a)
FR0000054470	UBISOFT ENTERTAINMENT	0	970	970	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000064578	COVIVIO	0	100	0	100 EUR	41.52	3'956.37	0.00	a)
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	0	49'503	6'752	42'751 EUR	187.90	7'654'429.20	0.68	a)
FR0000120172	CARREFOUR SA	0	110'489	0	110'489 EUR	15.53	1'635'047.04	0.15	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	0	426'207	28'487	397'720 EUR	58.99	22'356'076.09	1.99	a)
FR0000120321	L'OREAL	0	35'782	1'390	34'392 EUR	441.70	14'475'200.35	1.29	a)
FR0000120404	ACCOR SA	0	35'314	35'314	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120503	BOUYGUES SA	0	49'543	0	49'543 EUR	36.57	1'726'422.21	0.15	a)
FR0000120578	SANOFI	0	203'019	9'119	193'900 EUR	87.89	16'238'915.64	1.44	a)
FR0000120628	AXA SA	0	265'872	251	265'621 EUR	32.88	8'322'119.90	0.74	a)
FR0000120644	DANONE	0	90'335	0	90'335 EUR	59.02	5'080'366.06	0.45	a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	0	30'353	36	30'317 EUR	154.55	4'464'727.79	0.40	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	0	41'653	33	41'620 EUR	842.80	33'424'610.49	2.97	a)
FR0000121121	EURAZEO SE	0	26'374	247	26'127 EUR	78.10	1'944'376.36	0.17	a)
FR0000121204	WENDEL	0	8'430	8'430	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121220	SODEXO SA	0	33'491	0	33'491 EUR	73.70	2'351'989.37	0.21	a)
FR0000121485	KERING	0	11'261	11'261	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	0	52'227	52'227	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121709	SEB SA	0	9'197	9'197	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	0	80'455	0	80'455 EUR	23.48	1'800'076.18	0.16	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	0	89'646	0	89'646 EUR	209.80	17'921'574.09	1.59	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	0	45'476	0	45'476 EUR	28.65	1'241'499.75	0.11	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	0	88'521	522	87'999 EUR	71.20	5'970'318.26	0.53	a)
FR0000125338	CAPGEMINI SE	0	38'187	0	38'187 EUR	224.70	8'176'329.14	0.73	a)
FR0000125486	VINCI SA	0	83'068	0	83'068 EUR	118.40	9'371'847.41	0.83	a)
FR0000127771	VIVENDI SE	0	219'991	22'974	197'017 EUR	10.33	1'939'294.54	0.17	a)
FR0000130395	REMY COINTREAU	0	5'584	3'418	2'166 EUR	98.00	202'266.65	0.02	a)
FR0000130452	EIFFAGE	0	12'922	0	12'922 EUR	100.65	1'239'319.46	0.11	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	0	62'502	0	62'502 EUR	97.78	5'823'494.90	0.52	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	0	146'853	5'513	141'340 EUR	22.43	3'020'884.44	0.27	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	0	179'175	5'696	173'479 EUR	55.38	9'154'605.07	0.81	a)
FR0000131906	RENAULT SA	0	49'419	0	49'419 EUR	38.53	1'814'398.65	0.16	a)
FR0000133308	ORANGE	0	599'380	0	599'380 EUR	10.61	6'057'502.78	0.54	a)
FR0004125920	AMUNDI SA	0	5'408	0	5'408 EUR	60.85	313'571.81	0.03	a)
FR0006174348	BUREAU VERITAS SA	0	52'312	266	52'046 EUR	26.87	1'332'584.56	0.12	a)
FR0010040865	GECINA SA	0	7'139	0	7'139 EUR	89.30	607'475.26	0.05	a)
FR0010208488	ENGIE	0	287'154	1'311	285'843 EUR	14.84	4'040'956.15	0.36	a)
FR0010220475	ALSTOM	0	65'862	27'122	38'740 EUR	12.34	455'527.42	0.04	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	0	61'626	0	61'626 EUR	93.50	5'490'543.57	0.49	a)
FR0010313833	ARKEMA	0	20'681	0	20'681 EUR	95.76	1'887'102.21	0.17	a)
FR0010340141	ADP	0	11'999	730	11'269 EUR	125.70	1'349'771.98	0.12	a)
FR0010533075	GETLINK SE	0	125'223	1'372	123'851 EUR	15.79	1'863'465.68	0.17	a)
FR0010908533	EDENRED	0	55'802	0	55'802 EUR	45.79	2'434'782.44	0.22	a)
FR0011981968	WORLDLINE SA	0	77'897	24'845	53'052 EUR	10.63	537'118.92	0.05	a)
FR0013154002	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	0	11'525	11'525	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	0	26'662	26'662	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013280286	BIOMERIEUX	0	13'811	7'018	6'793 EUR	101.10	654'413.91	0.06	a)
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0	35'143	1'737	33'406 EUR	67.58	2'151'208.06	0.19	a)
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	0	33'912	0	33'912 EUR	38.72	1'251'205.10	0.11	a)
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	0	94'536	94'536	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	70'917	4'884	66'033 EUR	34.19	2'151'294.57	0.19	a)
NL0015001W49	PLUXEE NV	0	33'491	33'491	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR							233'916'324.86	20.77	
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	0	290'259	127'032	163'227 GBP	1'817.50	3'304'409.02	0.29	a)
GB0000536739	ASHTREAD GROUP PLC	0	75'069	1'566	73'503 GBP	5'680.00	4'650'297.96	0.41	a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	0	183'104	21'611	161'493 GBP	466.50	839'136.73	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB0001367019	BRITISH LAND CO PLC	0	155'475	155'475	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0002374006	DIAGEO PLC	0	464'664	0	464'664 GBP	2'962.00	15'330'328.49	1.36	a)
GB0004052071	HALMA PLC	0	115'217	259	114'958 GBP	2'302.00	2'947'622.74	0.26	a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	0	384'883	11'868	373'015 GBP	667.60	2'773'767.17	0.25	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	0	2'892'690	0	2'892'690 GBP	614.50	19'799'360.41	1.76	a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	0	1'109'894	0	1'109'894 GBP	242.10	2'992'979.02	0.27	a)
GB0006731235	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	0	74'979	12'475	62'504 GBP	2'273.00	1'582'466.87	0.14	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	0	205'831	3'661	202'170 GBP	960.60	2'163'150.19	0.19	a)
GB0006825383	PERSIMMON PLC	0	71'634	71'634	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	0	353'717	0	353'717 GBP	777.60	3'063'652.93	0.27	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	0	198'190	4'500	193'690 GBP	5'079.00	10'957'533.11	0.97	a)
GB0007669376	ST JAMES'S PLACE PLC	0	143'847	505	143'342 GBP	503.00	803'098.52	0.07	a)
GB0007908733	SSE PLC	0	109'827	69'618	40'209 GBP	1'625.50	728'010.48	0.06	a)
GB0007980591	BP PLC	0	3'263'774	272'940	2'990'834 GBP	460.70	15'347'509.16	1.36	a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	0	8'974'519	307'963	8'666'556 GBP	46.57	4'495'522.39	0.40	a)
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	0	833'902	0	833'902 GBP	137.85	1'280'410.32	0.11	a)
GB0009223206	SMITH & NEPHEW PLC	0	202'412	4'580	197'832 GBP	1'040.50	2'292'799.12	0.20	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	0	255'585	985	254'600 GBP	9'983.00	28'310'455.06	2.51	a)
GB0030913577	BT GROUP PLC	0	1'082'517	0	1'082'517 GBP	104.45	1'259'419.90	0.11	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	0	1'813'912	1'813'912	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	0	16'808	5'407	11'401 GBP	4'622.00	586'948.86	0.05	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	0	78'927	0	78'927 GBP	1'285.00	1'129'681.72	0.10	a)
GB0032089863	NEXT PLC	0	11'769	11'769	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0033195214	KINGFISHER PLC	0	654'135	7'898	646'237 GBP	234.50	1'687'959.60	0.15	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	0	513'789	86'730	427'059 GBP	249.60	1'187'298.28	0.11	a)
GB00B02J6398	ADMIRAL GROUP PLC	0	821	821	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B033F229	CENTRICA PLC	0	1'326'433	0	1'326'433 GBP	125.85	1'859'370.42	0.17	a)
GB00B0744838	BUNZL PLC	0	73'731	1'516	72'215 GBP	3'153.00	2'536'172.37	0.23	a)
GB00B082RF11	RENTOKIL INITIAL PLC	0	433'197	23'555	409'642 GBP	438.30	1'999'877.20	0.18	a)
GB00B05WJX34	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	0	64'653	0	64'653 GBP	8'876.00	6'391'949.79	0.57	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	0	457'917	0	457'917 GBP	3'866.50	19'721'146.59	1.75	a)
GB00B1FH8J72	SEVERN TRENT PLC	0	68'723	1'022	67'701 GBP	2'500.00	1'885'221.88	0.17	a)
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	0	26'376	0	26'376 GBP	3'303.00	970'386.82	0.09	a)
GB00B1VZOM25	HARGREAVES LANSDOWN PLC	0	32'589	32'589	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	0	106'259	6'085	100'174 GBP	1'608.00	1'794'190.03	0.16	a)
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	0	377'722	167'176	210'546 GBP	1'701.00	3'989'134.58	0.35	a)
GB00B1YW4409	3I GROUP PLC	0	187'662	0	187'662 GBP	2'468.00	5'158'802.19	0.46	a)
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	0	131'261	131'261	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	0	347'688	0	347'688 GBP	3'461.00	13'403'514.27	1.19	a)
GB00B39J2M42	UNITED UTILITIES GROUP PLC	0	112'893	4'040	108'853 GBP	1'025.00	1'242'772.54	0.11	a)
GB00B52N1N88	SEGRO PLC	0	191'922	61'426	130'496 GBP	845.40	1'228'815.90	0.11	a)
GB00B63H8491	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	0	1'412'207	71'961	1'340'246 GBP	369.10	5'510'055.14	0.49	a)
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	0	316'121	0	316'121 GBP	2'170.00	7'640'828.65	0.68	a)
GB00BDPCN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	0	43'170	18'428	24'742 USD	68.63	1'495'212.17	0.13	a)
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	0	560'335	44'359	515'976 GBP	1'037.50	5'962'727.83	0.53	a)
GB00BF8Q6K64	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	0	463'084	32'756	430'328 GBP	157.40	754'452.17	0.07	a)
GB00BGXQNP29	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	0	4'611	4'611	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	0	5'539'129	0	5'539'129 GBP	69.12	4'264'543.89	0.38	a)
GB00BHJYC057	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	0	13'532	13'394	138 GBP	8'380.00	12'881.03	0.00	a)
GB00BJFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	0	47'347	0	47'347 GBP	4'766.00	2'513'471.03	0.22	a)
GB00BKFB1C65	M&G PLC	0	695'555	0	695'555 GBP	224.70	1'740'852.32	0.15	a)
GB00BL6K5J42	ENDEAVOUR MINING PLC	0	75'877	15'639	60'238 GBP	1'275.00	855'476.55	0.08	a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	0	1'461'076	0	1'461'076 GBP	278.80	4'537'252.58	0.40	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	0	1'222'571	0	1'222'571 GBP	239.10	3'255'974.88	0.29	a)
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	329'453	45'282	284'171 GBP	810.20	2'564'480.34	0.23	a)
GB00BMWC6P49	MONDI PLC	0	88'007	0	88'007 GBP	1'408.50	1'380'706.76	0.12	a)
GB00BMWRZ071	DOWLAIS GROUP PLC	0	86'068	86'068	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BN7SWP63	GSK PLC	0	619'369	619'369	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BNGDN821	MELROSE INDUSTRIES PLC	0	227'772	86'068	141'704 GBP	635.00	1'002'266.50	0.09	a)
GB00BNR5MZ78	MELROSE INDUSTRIES PLC	0	258'204	258'204	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	0	1'071'187	10'536	1'060'651 GBP	2'457.00	29'027'193.10	2.58	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BP9LHF23	SCHROEDERS PLC	0	42'710	19'846	22'864	GBP	393.30	100'162.12	0.01 a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	0	509'165	0	509'165	GBP	446.30	2'531'120.44	0.22 a)
GB00BVVVF23	AUTO TRADER GROUP PLC	0	192'292	1'028	191'264	GBP	740.40	1'577'346.21	0.14 a)
GB00BWF6Q14	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	0	12'349	1'768	10'581	GBP	10'325.00	1'216'869.92	0.11 a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	0	151'830	0	151'830	GBP	619.60	1'047'843.40	0.09 a)
GB00BZ4BQC70	JOHNSON MATTHEY PLC	0	45'798	45'798	0	GBP	0.00	0.00	0.00
JE00B4T3BW64	GLENCORE PLC	0	51'352	51'352	0	GBP	0.00	0.00	0.00
JE00B8KF9B49	WPP PLC	0	281'414	122'631	158'783	GBP	707.20	1'250'759.00	0.11 a)
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	0	1'090	1'090	0	GBP	0.00	0.00	0.00
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	0	120'070	120'070	0	EUR	0.00	0.00	0.00
GB							271'937'648.66	24.15	
GB00B19NLV48	EXPERIAN PLC	0	130'319	130'319	0	GBP	0.00	0.00	0.00
IE0001827041	CRH PLC	0	105'774	3'352	102'422	GBP	6'574.00	7'499'811.22	0.67 a)
IE0002424939	DCC PLC	0	14'550	0	14'550	GBP	5'616.00	910'159.43	0.08 a)
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	0	12'665	4'413	8'252	EUR	81.14	638'019.53	0.06 a)
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	0	28'068	122	27'946	EUR	83.48	2'223'012.21	0.20 a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	46'980	46'980	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	0	316'638	33'486	283'152	EUR	8.05	2'173'056.47	0.19 a)
IE00BFOL3536	AIB GROUP PLC	0	526'339	526'339	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	0	38'909	5'041	33'868	GBP	17'105.00	6'452'678.24	0.57 a)
IE							19'896'737.10	1.77	
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	0	97'428	421	97'007	GBP	913.00	986'509.41	0.09 a)
IM							986'509.41	0.09	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	0	126'406	126'406	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	0	129'795	129'795	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	0	2'634'274	2'634'274	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0003128367	ENEL SPA	0	1'414'343	1'342	1'413'001	EUR	5.88	7'921'019.27	0.70 a)
IT0003153415	SNAM SPA	0	886'061	0	886'061	EUR	4.32	3'648'275.61	0.32 a)
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	0	364'116	364'116	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0003492391	DIASORIN SPA	0	21'397	0	21'397	EUR	93.38	1'903'910.41	0.17 a)
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	0	2'417'464	414'459	2'003'005	EUR	0.28	530'790.05	0.05 a)
IT0003506190	ATLANTIA SPA	0	3'258	3'258	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0003828271	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	0	51'682	51'682	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0004056880	AMPLIFON SPA	0	54'911	0	54'911	EUR	30.89	1'616'281.54	0.14 a)
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	0	124'469	2'609	121'860	EUR	46.05	5'347'250.88	0.47 a)
IT0004965148	MONCLER SPA	0	49'884	49'884	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0005239360	UNICREDIT SPA	0	320'530	0	320'530	EUR	30.91	9'440'770.51	0.84 a)
IT0005366767	NEXI SPA	0	135'887	3'499	132'388	EUR	6.77	854'542.30	0.08 a)
NL0011585146	FERRARI NV	0	29'162	0	29'162	EUR	389.90	10'834'535.40	0.96 a)
NL0015435975	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	0	204'135	0	204'135	EUR	9.37	1'823'011.91	0.16 a)
IT							43'920'387.88	3.90	
GB00B0LCW083	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	0	61'013	0	61'013	GBP	1'967.00	1'336'762.09	0.12 a)
JO							1'336'762.09	0.12	
LU1598757687	ARCELORMITTAL	0	69'044	41'969	27'075	EUR	24.12	622'279.54	0.06 a)
LU							622'279.54	0.06	
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	0	23'138	5'985	17'153	EUR	71.40	1'167'019.34	0.10 a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	0	810'078	0	810'078	EUR	3.38	2'611'371.06	0.23 a)
NL0000009165	HEINEKEN NV	0	43'431	13'564	29'867	EUR	85.42	2'431'033.37	0.22 a)
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	0	178'978	49'495	129'483	EUR	18.50	2'282'817.44	0.20 a)
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	0	27'988	27'988	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0000303709	AEGON NV	0	474'195	474'195	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0000379121	RANDSTAD NV	0	21'757	9'402	12'355	EUR	50.94	599'710.21	0.05 a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	0	54'266	9'710	44'556	EUR	145.85	6'192'305.59	0.55 a)
NL0006294274	EURONEXT NV	0	22'054	0	22'054	EUR	85.25	1'791'519.38	0.16 a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	0	63'278	656	62'622	EUR	870.50	51'944'008.56	4.61 a)
NL0010558797	OCI NV	0	12'614	12'356	258	EUR	24.35	5'986.30	0.00 a)
NL0010773842	NN GROUP NV	0	30'745	2'073	28'672	EUR	41.26	1'127'267.44	0.10 a)
NL0010801007	IMCD NV	0	24'588	10'946	13'642	EUR	140.90	1'831'592.22	0.16 a)
NL0011540547	ABN AMRO BANK NV-CVA	0	67'912	0	67'912	EUR	14.85	960'976.41	0.09 a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	0	152'032	10'669	141'363	EUR	27.52	3'707'011.51	0.33 a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NL0011821202	ING GROEP NV	0	908'758	440'116	468'642	EUR	12.69	5'666'861.28	0.50 a)
NL0011872643	ASR NEDERLAND NV	0	30'337	0	30'337	EUR	42.63	1'232'331.97	0.11 a)
NL0012169213	QIAGEN N.V.	0	64'541	64'541	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0012969182	ADYEN NV	0	2'939	0	2'939	EUR	1'460.00	4'088'765.41	0.36 a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	0	32'502	0	32'502	EUR	67.34	2'085'561.26	0.19 a)
NL0013654783	PROSUS NV	0	237'226	18'054	219'172	EUR	26.99	5'636'736.16	0.50 a)
NL0014332678	JDE PEET'S NV	0	56'400	21'001	35'399	EUR	21.14	713'075.85	0.06 a)
NL00150001Q9	STELLANTIS NV	0	477'258	4'806	472'452	EUR	24.14	10'865'375.68	0.96 a)
NL0015001FS8	FERROVIAL SE	0	132'915	33'093	99'822	EUR	34.65	3'295'863.81	0.29 a)
NL0015001WM6	QIAGEN N.V.	0	62'605	0	62'605	EUR	39.64	2'364'436.39	0.21 a)
NL								112'601'626.64	10.00
NO0003054108	MOWI ASA	0	99'131	643	98'488	NOK	204.90	1'676'502.28	0.15 a)
NO0003733800	ORKLA ASA	0	190'035	40'711	149'324	NOK	76.06	943'549.76	0.08 a)
NO0005052605	NORSK HYDRO ASA	0	641'712	0	641'712	NOK	54.54	2'907'596.69	0.26 a)
NO0010063308	TELENOR ASA	0	145'816	43'106	102'710	NOK	116.20	991'511.44	0.09 a)
NO0010161896	DNB BANK ASA	0	268'598	20'186	248'412	NOK	212.30	4'381'284.31	0.39 a)
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	0	19'814	8'397	11'417	NOK	330.00	313'000.34	0.03 a)
NO0010310956	SALMAR ASA	0	28'211	3'366	24'845	NOK	673.40	1'389'923.78	0.12 a)
NO0010582521	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	0	101'084	101'084	0	NOK	0.00	0.00	0.00
NO0010844038	ADEVINTA ASA-B	0	90'636	1'947	88'689	NOK	113.40	835'529.30	0.07 a)
NO								13'438'897.90	1.19
PTEDPOAM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	0	408'568	0	408'568	EUR	3.68	1'432'299.66	0.13 a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	0	49'859	49'859	0	EUR	0.00	0.00	0.00
PT								1'432'299.66	0.13
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	0	111'016	111'016	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0000108227	SKF AB-B SHARES	0	41'996	1'757	40'239	SEK	225.80	773'199.91	0.07 a)
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	0	604'908	0	604'908	SEK	56.23	2'894'530.24	0.26 a)
SE0000112724	SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	0	117'390	117'390	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0000113250	SKANSKA AB-B SHS	0	71'733	0	71'733	SEK	191.00	1'165'931.52	0.10 a)
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	0	44'856	10'035	34'821	SEK	288.80	855'774.04	0.08 a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	0	293'707	23'342	270'365	SEK	285.10	6'559'464.21	0.58 a)
SE0000202624	GETINGE AB-B SHS	0	133'989	67'228	66'761	SEK	205.20	1'165'791.46	0.10 a)
SE0000242455	SWEDBANK AB - A SHARES	0	226'160	30'703	195'457	SEK	227.40	3'782'355.71	0.34 a)
SE0000667891	SANDVIK AB	0	167'867	16'275	151'592	SEK	232.90	3'004'460.17	0.27 a)
SE0000667925	TELIA CO AB	0	596'922	0	596'922	SEK	24.67	1'253'162.57	0.11 a)
SE0000695876	ALFA LAVAL AB	0	46'551	0	46'551	SEK	389.70	1'543'761.13	0.14 a)
SE0000872095	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	0	51'201	0	51'201	SEK	254.60	1'109'321.74	0.10 a)
SE0001515552	INDUTRADE AB	0	45'473	0	45'473	SEK	274.00	1'060'290.45	0.09 a)
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	0	53'309	53'000	309	SEK	79.86	2'099.95	0.00 a)
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	127'372	3'215	124'157	SEK	86.92	918'357.14	0.08 a)
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	0	215'472	0	215'472	SEK	295.40	5'416'540.74	0.48 a)
SE0007100599	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	0	300'886	0	300'886	SEK	123.80	3'169'883.53	0.28 a)
SE0010100958	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	0	64'658	10'813	53'845	SEK	262.60	1'203'263.61	0.11 a)
SE0012853455	EQT AB	0	102'585	26'082	76'503	SEK	303.00	1'972'612.47	0.18 a)
SE0015658109	EPIROC AB-A	0	97'882	0	97'882	SEK	187.75	1'563'880.13	0.14 a)
SE0015658117	EPIROC AB-B	0	53'246	31'566	21'680	SEK	170.80	315'114.09	0.03 a)
SE0015810247	KINNEVIK AB - B	0	73'614	73'614	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0015811955	INVESTOR AB-A SHS	0	30'295	30'295	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0015811963	INVESTOR AB-B SHS	0	419'937	0	419'937	SEK	260.40	9'305'630.45	0.83 a)
SE0015812219	SWEDISH MATCH AB	0	8'792	8'792	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0015949201	LIFCO AB-B SHS	0	47'973	0	47'973	SEK	275.80	1'125'931.11	0.10 a)
SE0015949748	BEIJER REF AB	0	109'932	0	109'932	SEK	145.60	1'362'091.19	0.12 a)
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	0	397'178	97'896	299'282	SEK	57.78	1'471'562.85	0.13 a)
SE0016589188	ELECTROLUX AB-B	0	44'601	44'601	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0016844831	VOLVO CAR AB-B	0	163'167	87'317	75'850	SEK	37.76	243'729.59	0.02 a)
SE0017486889	ATLAS COPCO AB-A SHS	0	370'951	0	370'951	SEK	179.75	5'674'219.41	0.50 a)
SE0017486897	ATLAS COPCO AB-B SHS	0	243'104	8'446	234'658	SEK	154.85	3'092'197.71	0.27 a)
SE0017768716	BOLIDEN AB	0	89'145	89'145	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0020050417	BOLIDEN AB	0	114'801	114'801	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE								62'005'157.12	5.51

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	51'336	1'663	49'673 USD	77.18	3'375'819.25	0.30	a)
US							3'375'819.25	0.30	
GB00B1CRLC47	MONDI PLC	0	105'232	105'232	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
ZA							0.00	0.00	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
DE000A2GSYQ9	VONOVIA SE-SCRIP	0	151'460	151'460	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06189009K1	FERROVIAL SA-RTS	0	3'671	3'671	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0627797907	EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	0	125'377	125'377	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809P3	IBERDROLA SA-RTS	0	39'559	39'559	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809Q1	IBERDROLA SA-RTS	0	789'552	789'552	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809R9	IBERDROLA SA-RTS	0	995'826	995'826	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509M2	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	0	3'728	3'728	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509N0	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	0	74'725	74'725	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509O8	ACS ACTIVIDADES DE CONS-RTS	0	66'896	66'896	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400GCH7	ESSILORLUXOTTICA SA-SCRIP	0	42'465	42'465	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400IKH6	ALSTOM SA-SCRIP	0	39'185	39'185	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XR77	SHELL PLC-EEE AUG23	0	954'138	954'138	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	1'020'227	1'020'227	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	0	46'988	46'988	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XV14	SHELL PLC-EEE MAY23	0	872'512	872'512	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BPV8W887	SHELL PLC-EEE NOV2022	0	35'959	35'959	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	1'071'187	0	1'071'187 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	34'510	34'510	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001FK5	ARCELORMITTAL SA	0	62'555	62'555	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001GE6	AEGON NV-DRIP	0	324'491	324'491	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001I05	FERROVIAL SE-SCRIP	0	100'068	100'068	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LH9	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	44'130	44'130	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001MH7	AEGON NV-DRIP	0	421'258	421'258	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001RN4	FERROVIAL SE-SCRIP	0	121'388	121'388	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001S86	ARCELORMITTAL SA	0	46'695	46'695	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Futures							0.00	0.00	
12/22	EURO STOXX 50 DEC22	0	29	29	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	FTSE 100 IDX FUT DEC22	0	6	6	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	0	43	43	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	FTSE 100 IDX FUT MAR23	0	9	9	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	473	473	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	104	104	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO STOXX 50 SEP23	0	502	502	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	FTSE 100 IDX FUT SEP23	0	108	108	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	0	408	408	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	89	89	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	334	243	91 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	77	55	22 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 28.12.2022		25'000	24'584		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 28.12.2022		190'000	25'125		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 29.12.2022		24'000	23'672		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 29.12.2022		11'000	12'312		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.01.2023		95'000	106'100		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.01.2023		195'000	192'224		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2023		350'000	30'915		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2023		28'000	31'169		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2023		60'000	59'106		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 09.05.2023		450'000	439'037		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 27.12.2023		823'000	777'530		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		700'000	650'154		EUR/CHF	0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % (7)
Bankguthaben auf Sicht	8'901'762.28	0.79
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'115'793'944.74	99.08
Sonstige Vermögenswerte	1'468'240.72	0.13
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'126'163'947.74	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-316.05	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'126'163'631.69	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % (7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'115'793'944.74	99.08
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

DKK	100 = CHF	12.78327000
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
NOK	100 = CHF	8.30766300
SEK	100 = CHF	8.50982600
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	6'099'347.23	0.542
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.11.2022 - 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	
GT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.221	0.00 - 0.04	-	0.019
NT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.221	0.00 - 0.04	-	0.019
ST CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.221	0.00 - 0.04	-	0.019

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
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.

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.11.2022 - 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
GT CHF	0.150	0.350	0.100	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
ST 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.

8 Benchmark

MSCI Europe ex Switzerland In-dex TR Net

9 TER

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

10 Thesaurierung des Nettoertrags 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
GT CHF	Ja	CHF	3.484	1.219	2.265
NT CHF	Ja	CHF	3.711	1.298	2.413
ST CHF	Ja	CHF	3'711.14	1'298.89	2'412.25

11 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.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

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

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

Mitteilung an die 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 Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich der Anteilsklasse 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 (Vereinigungstichtag).

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 Anteilsklassen 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 Vereinbarung 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