

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

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

Jahresbericht per 30. September 2021

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation	2
Abschlusszahlen	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
Pauschale Verwaltungskommission	14
Benchmark	14
TER	14
Ausschüttung des Nettoertrags 2020 / 2021	14
Thesaurierung des Nettoertrags 2020 / 2021	15
Erklärung der Fussnoten	15
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
Bericht der Prüfgesellschaft	17

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 27.01.2022

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

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

Verwaltungsrat

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

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

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

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer

Andreas Hogg
stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Fondsadministration

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

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

Übersicht	von	01.10.2020	01.10.2019	01.10.2018	01.10.2017
	bis	30.09.2021	30.09.2020	30.09.2019	30.09.2018
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'771'745'267.02	3'297'732'960.45	3'202'998'834.35	2'430'065'523.92
Klasse ASTT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'138'941'571.47	1'012'571'434.33	1'009'960'290.06	834'164'563.22
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'915'583.363	8'307'250.650	8'604'865.515	8'032'034.649
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		143.8860	121.8901	117.3708	103.8500
Thesaurierung je Anteil		3.09	2.88	2.58	2.25
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.19 %	0.30 %
Klasse DA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		81'778'456.55	71'058'678.30	76'961'628.05	71'963'358.64
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		448'109.458	449'741.758	494'717.815	510'505.815
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		182.4966	157.9988	155.5667	140.9600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR 18)		168.8023	146.6522	143.1030	-
Ausschüttung je Anteil		4.00	3.60	3.60	3.20
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		13'032'114.00	13'800'429.03	15'197'848.71	14'483'776.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		91'788.228	113'842.094	129'232.673	138'061.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		141.9802	121.2243	117.6007	104.9100
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR 18)		131.3262	112.5186	108.1787	-
Thesaurierung je Anteil		3.05	2.86	2.61	2.41
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		225'487'317.58	216'048'583.76	224'477'007.59	234'616'866.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'237'224.365	1'368'794.645	1'443'969.436	1'665'006.962
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		182.2526	157.8386	155.4583	140.9100
Ausschüttung je Anteil		3.80	3.60	3.60	3.20
Total Expense Ratio (TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		358'297'070.20	705'706'208.28	798'107'388.33	602'264'596.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'766'161.986	4'074'821.880	4'751'017.201	4'019'460.593
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		202.8676	173.1870	167.9866	149.8400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR 18)		187.6447	160.7496	154.5278	-
Thesaurierung je Anteil		4.40	4.13	3.77	3.48
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'954'208'737.22	1'278'547'626.75	1'078'294'671.61	672'572'362.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'440'751.683	7'242'056.326	6'303'004.170	4'411'598.212
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		206.9972	176.5448	171.0763	152.4600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR 18)		191.4643	163.8663	157.3700	-
Thesaurierung je Anteil		4.76	4.45	4.05	3.74
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance	YTD / 30.09.2021	2020	2019	2018
Klasse ASTT CHF	12.71 %	3.66 %	30.47 %	-8.82 %
Klasse DA CHF	12.71 %	3.65 %	30.45 %	-8.68 %
Klasse DT CHF	12.71 %	3.66 %	30.46 %	-8.69 %
Klasse FA CHF	12.68 %	3.62 %	30.41 %	-8.70 %
Klasse GT CHF	12.73 %	3.68 %	30.48 %	-8.66 %
Klasse NT CHF	12.85 %	3.83 %	30.67 %	-8.53 %
Benchmark	12.88 %	3.82 %	30.59 %	-8.57 %
Tracking Error *	-	0.05 %	0.03 %	0.04

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

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

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)

	30.09.2021	30.09.2020
Bankguthaben auf Sicht	3'741'243.15	15'796'779.61
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	3'747'942'797.82	3'262'484'829.75
Sonstige Vermögenswerte	20'307'882.26	19'715'814.33
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'771'991'923.23	3'297'997'423.69
Andere Verbindlichkeiten	-246'656.21	-264'463.24
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'771'745'267.02	3'297'732'960.45

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse ASTT CHF	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	30.09.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			8'307'250.650	8'604'865.515
Ausgegebene Anteile			168'843.228	190'971.942
Zurückgenommene Anteile			-560'510.515	-488'586.807
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			7'915'583.363	8'307'250.650

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DA CHF	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	30.09.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			449'741.758	494'717.815
Ausgegebene Anteile			22'496.100	34'347.843
Zurückgenommene Anteile			-24'128.400	-79'323.900
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			448'109.458	449'741.758

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DT CHF	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	30.09.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			113'842.094	129'232.673
Ausgegebene Anteile			10'637.689	13'679.311
Zurückgenommene Anteile			-32'691.555	-29'069.890
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			91'788.228	113'842.094

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse FA CHF	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	30.09.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			1'368'794.645	1'443'969.436
Ausgegebene Anteile			103'601.411	178'888.610
Zurückgenommene Anteile			-235'171.691	-254'063.401
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			1'237'224.365	1'368'794.645

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse GT CHF	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	30.09.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			4'074'821.880	4'751'017.201
Ausgegebene Anteile			632'113.015	1'673'942.261
Zurückgenommene Anteile			-1'869'872.909	-2'350'137.582
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)			-1'070'900.000	0.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			1'766'161.986	4'074'821.880

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT CHF	von	01.10.2020	01.10.2019
		bis	30.09.2021	30.09.2020
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			7'242'056.326	6'303'004.170
Ausgegebene Anteile			2'571'612.672	2'223'913.182
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)			335'718.467	259'210.123
Zurückgenommene Anteile			-708'635.782	-1'187'351.576
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)			-	-356'719.573
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			9'440'751.683	7'242'056.326

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)		Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse	NT CHF	15.12.2020	53'638'085.71	300'147.593
Klasse	NT CHF	05.03.2021	6'516'402.71	35'570.874
Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)		Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse	GT CHF	23.10.2020	182'302'412.61	1'070'900.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

	(konsolidiert)	von bis	01.10.2020 30.09.2021	01.10.2019 30.09.2020
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			3'297'732'960.45	3'202'998'834.35
Ausbezahlte Ausschüttung			-6'162'388.61	-6'968'118.77
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-16'686'059.51	-14'405'106.59
Saldo aus dem Anteilverkehr			-82'282'447.57	-30'382'218.49
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			579'143'202.26	146'489'569.95
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			3'771'745'267.02	3'297'732'960.45

Erfolgsrechnung

	(konsolidiert)	von bis	01.10.2020 30.09.2021	01.10.2019 30.09.2020
Ertrag				
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-77'474.56	-106'859.76
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte			88'126'267.78	83'638'481.72
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			909.00	0.00
Erträge der Gratisaktien			0.00	14'569.30
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			6'237'946.34	8'052'329.12
Total Ertrag			94'287'648.56	91'598'520.38
Aufwand				
Reglementarische Vergütungen			-2'951'159.78	-3'255'361.35
Sonstige Aufwendungen			0.00	-1.33
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-7'268'839.52	-8'235'753.27
Total Aufwand			-10'219'999.30	-11'491'115.95
Nettoertrag / Verlust			84'067'649.26	80'107'404.43
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			114'081'958.01	76'336'078.86
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip			8'894'592.16	8'307'802.87
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen			188'011.44	169'365.14
Realisierter Erfolg			207'232'210.87	164'920'651.30
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			371'910'991.39	-18'431'081.35
Gesamterfolg			579'143'202.26	146'489'569.95

Verwendung des Erfolges	Klasse ASTT CHF	30.09.2021	30.09.2020
Nettoertrag		24'506'103.72	23'970'550.07
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		24'506'103.72	23'970'550.07
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage *		24'506'103.72	23'970'550.07
Total		24'506'103.72	23'970'550.07
Verwendung des Erfolges	Klasse DA CHF	30.09.2021	30.09.2020
Nettoertrag		1'759'564.97	1'680'469.58
Vortrag des Vorjahres		73'482.28	12'083.03
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		1'833'047.25	1'692'552.61
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		1'792'437.83	1'619'070.33
Vortrag auf neue Rechnung		40'609.42	73'482.28
Total		1'833'047.25	1'692'552.61
Verwendung des Erfolges	Klasse DT CHF	30.09.2021	30.09.2020
Nettoertrag		280'420.09	326'658.24
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		280'420.09	326'658.24
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		98'147.03	114'330.38
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		182'273.06	212'327.86
Total		280'420.09	326'658.24
Verwendung des Erfolges	Klasse FA CHF	30.09.2021	30.09.2020
Nettoertrag		4'776'499.10	5'049'310.98
Vortrag des Vorjahres		129'620.01	7'969.75
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		4'906'119.11	5'057'280.73
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		4'701'452.59	4'927'660.72
Vortrag auf neue Rechnung		204'666.52	129'620.01
Total		4'906'119.11	5'057'280.73
Verwendung des Erfolges	Klasse GT CHF	30.09.2021	30.09.2020
Nettoertrag		7'776'619.88	16'840'611.35
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		7'776'619.88	16'840'611.35
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		2'721'816.96	5'894'213.97
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		5'054'802.92	10'946'397.38
Total		7'776'619.88	16'840'611.35
Verwendung des Erfolges	Klasse NT CHF	30.09.2021	30.09.2020
Nettoertrag		44'968'441.50	32'239'804.21
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		44'968'441.50	32'239'804.21
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		15'738'954.53	11'283'931.47
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		29'229'486.97	20'955'872.74
Total		44'968'441.50	32'239'804.21

* Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind								3'747'942'797.82	99.36	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								3'747'942'797.82	99.36	
CH0001624714	CPH CHEMIE & PAPIER HLDG-REG	2'680	0	0	2'680	CHF	71.60	191'888.00	0.01	a)
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	986'977	1'119'377	471'944	1'634'410	CHF	0.38	626'796.24	0.02	a)
CH0008012236	GURIT HOLDING AG-BR	760	115	88	787	CHF	1'746.00	1'374'102.00	0.04	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	17'806	2'733	2'635	17'904	CHF	4'262.00	76'306'848.00	2.02	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	554'921	81'777	134'633	502'065	CHF	17.63	8'848'895.63	0.23	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	1'131'854	296'880	167'232	1'261'502	CHF	45.14	56'944'200.28	1.51	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	15'301	2'094	2'103	15'292	CHF	884.00	13'518'128.00	0.36	a)
CH0021218067	EVOLVA HOLDING SA	1'599'882	451'358	0	2'051'240	CHF	0.15	299'070.79	0.01	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	317'010	48'123	46'820	318'313	CHF	296.80	94'475'298.40	2.50	a)
CH0435377954	SIG COMBIBLOC GROUP AG	607'604	200'526	84'446	723'684	CHF	24.92	18'034'205.28	0.48	a)
CH0453226893	ALUFLEXPAC AG	0	18'912	0	18'912	CHF	33.10	625'987.20	0.02	a)
CH0460027110	BLACKSTONE RESOURCES AG	0	31'479	2'591	28'888	CHF	3.34	96'485.92	0.00	a)
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	30'751	3'111	2'794	31'068	CHF	57.90	1'798'837.20	0.05	a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	0	4'755	0	4'755	CHF	308.00	1'464'540.00	0.04	a)
Materials								274'605'282.94	7.28	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	446'877	73'915	89'345	431'447	CHF	10.24	4'418'017.28	0.12	a)
CH0001503199	BELIMO HOLDING AG-REG	1'104	123	1'227	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0001752309	FISCHER (GEORG)-REG	9'009	1'326	1'259	9'076	CHF	1'390.00	12'615'640.00	0.33	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	129'587	12'785	10'362	132'010	CHF	38.98	5'145'749.80	0.14	a)
CH0002187810	PHOENIX MECANO AG-BR	2'398	0	593	1'805	CHF	447.00	806'835.00	0.02	a)
CH0002361068	STARRAG GROUP HOLDING AG	1'099	0	0	1'099	CHF	48.20	52'971.80	0.00	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	14'675	2'345	2'003	15'017	CHF	446.00	6'697'582.00	0.18	a)
CH0002497458	SGS SA-REG	13'728	1'999	2'106	13'621	CHF	2'726.00	37'130'846.00	0.98	a)
CH0003245351	VON ROLL HOLDING AG-BR	168'536	0	0	168'536	CHF	1.04	175'277.44	0.00	a)
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	10'535	0	0	10'535	CHF	7.50	79'012.50	0.00	a)
CH0003420806	ORELL FUSSLER HOLDING AG-REG	1'725	0	0	1'725	CHF	91.00	156'975.00	0.00	a)
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	7'830	2'645	4'075	6'400	CHF	205.00	1'312'000.00	0.03	a)
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	1'504	285	238	1'551	CHF	3'950.00	6'126'450.00	0.16	a)
CH0008207356	BVZ HOLDING AG-REG NEW	124	0	0	124	CHF	735.00	91'140.00	0.00	a)
CH0008967926	ADVAL TECH HOLDING AG-REG	364	0	0	364	CHF	171.00	62'244.00	0.00	a)
CH0009320091	FEINTOOL INTL HOLDING-REG	6'059	0	0	6'059	CHF	60.50	366'569.50	0.01	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	9'094	442	783	8'753	CHF	246.20	2'154'988.60	0.06	a)
CH0010754924	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG-BR	2'308	201	234	2'275	CHF	1'340.00	3'048'500.00	0.08	a)
CH0011003594	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-BR	817	474	0	1'291	CHF	250.00	322'750.00	0.01	a)
CH0011607683	TORNOS HOLDING AG - REG	15'941	0	0	15'941	CHF	7.61	121'311.01	0.00	a)
CH0011795959	DORMAKABA HOLDING AG	6'706	1'143	1'104	6'745	CHF	679.00	4'579'855.00	0.12	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	365'242	59'560	49'595	375'207	CHF	47.02	17'642'233.14	0.47	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	4'323'252	512'183	1'233'092	3'602'343	CHF	31.39	113'077'546.77	3.00	a)
CH0012684657	BOBST GROUP SA-REG	18'182	7'295	7'129	18'348	CHF	80.90	1'484'353.20	0.04	a)
CH0017875789	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG	11'749	2'211	1'220	12'740	CHF	137.60	1'753'024.00	0.05	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	24'865	9'225	4'129	29'961	CHF	20.70	620'192.70	0.02	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	90'594	11'155	11'799	89'950	CHF	251.20	22'595'440.00	0.60	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	44'098	13'874	10'937	47'035	CHF	241.40	11'354'249.00	0.30	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	126'259	17'882	16'254	127'887	CHF	319.40	40'847'107.80	1.08	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	6'795	880	673	7'002	CHF	377.00	2'639'754.00	0.07	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	82'835	11'688	14'225	80'298	CHF	689.00	55'325'322.00	1.47	a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	36'281	10'482	9'994	36'769	CHF	72.30	2'658'398.70	0.07	a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	18'295	1'812	3'312	16'795	CHF	332.00	5'575'940.00	0.15	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	38'820	3'825	3'957	38'688	CHF	89.20	3'450'969.60	0.09	a)
CH0100837282	KARDEX HOLDING AG-REG	12'583	3'019	2'090	13'512	CHF	264.50	3'573'924.00	0.09	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	137'185	11'886	19'272	129'799	CHF	18.24	2'367'533.76	0.06	a)
CH0110303119	LECLANCHE SA-REG	0	165'975	0	165'975	CHF	0.69	114'190.80	0.00	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	79'955	14'755	11'893	82'817	CHF	73.25	6'066'345.25	0.16	a)
CH0208062627	MEIER TOBLER GROUP AG	23'692	0	0	23'692	CHF	19.10	452'517.20	0.01	a)
CH0212255803	BURKHALTER HOLDING AG	12'626	4'369	2'198	14'797	CHF	66.10	978'081.70	0.03	a)
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	13'312	1'731	2'463	12'580	CHF	293.00	3'685'940.00	0.10	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	36'174	9'330	7'886	37'618	CHF	127.20	4'785'009.60	0.13	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	3'494	414	534	3'374	CHF	1'264.00	4'264'736.00	0.11	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	24'669	6'136	7'132	23'673	CHF	99.20	2'348'361.60	0.06	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	59'703	9'406	8'525	60'584	CHF	370.20	22'428'196.80	0.59	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	42'627	6'959	7'490	42'096	CHF	167.00	7'030'032.00	0.19	a)
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	8'497	0	0	8'497	CHF	16.00	135'952.00	0.00	a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	0	22'931	708	22'223	CHF	494.00	10'978'162.00	0.29	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	0	45'066	0	45'066	CHF	33.40	1'505'204.40	0.04	a)
Industrials								435'203'432.95	11.54	
AT0000KTM102	PIERER MOBILITY AG	21'480	0	2'601	18'879	CHF	81.30	1'534'862.70	0.04	a)
CH0002088976	VALORA HOLDING AG-REG	7'431	4'799	3'342	8'888	CHF	183.00	1'626'504.00	0.04	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	2'597	417	520	2'494	CHF	1'846.00	4'603'924.00	0.12	a)
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	126'979	35'217	34'739	127'457	CHF	48.20	6'143'427.40	0.16	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	63'427	11'547	11'238	63'736	CHF	245.50	15'647'188.00	0.41	a)
CH0023405456	DUFREY AG-REG	84'046	86'931	22'678	148'299	CHF	52.82	7'833'153.18	0.21	a)
CH0038285679	ORASCOM DEVELOPMENT HOLDING	28'173	0	0	28'173	CHF	11.12	313'283.76	0.01	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	8'532	1'550	0	10'082	CHF	45.10	454'698.20	0.01	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	6'580	1'454	1'117	6'917	CHF	151.50	1'047'925.50	0.03	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1'166'506	176'996	171'852	1'171'650	CHF	97.42	114'142'143.00	3.03	a)
CH0276837694	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	107'890	14'169	8'551	113'508	CHF	12.94	1'468'793.52	0.04	a)
CH0527044959	BERGBAHNEN ENGELB. TRUEB-REG	3'275	0	0	3'275	CHF	46.30	151'632.50	0.00	a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	5'000	3'728	2'068	6'660	CHF	130.40	868'464.00	0.02	a)
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	11'260	1'883	1'244	11'899	CHF	39.30	467'630.70	0.01	a)
Consumer Discretionary								156'303'630.46	4.14	
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	6'766	2'133	857	8'042	CHF	2'120.00	17'049'040.00	0.45	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	242	37	35	244	CHF	109'900.00	26'815'600.00	0.71	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2'287	339	249	2'377	CHF	10'420.00	24'768'340.00	0.66	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	4'545	1'090	1'036	4'599	CHF	963.00	4'428'837.00	0.12	a)
CH0012949464	GROUPE MINOTERIES SA-REG	261	0	0	261	CHF	416.00	108'576.00	0.00	a)
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	2'860	0	0	2'860	CHF	42.00	120'120.00	0.00	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	6'436'891	946'901	1'062'404	6'321'388	CHF	112.70	712'420'427.60	18.89	a)
CH0042615283	ZUR ROSE GROUP AG	21'624	3'584	3'558	21'650	CHF	374.00	8'097'100.00	0.21	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	2'336'852	626'228	695'276	2'267'804	CHF	1.40	3'174'925.60	0.08	a)
CH0111677362	ORIOR AG	19'169	6'339	8'081	17'427	CHF	91.20	1'589'342.40	0.04	a)
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	6'261	786	1'508	5'539	CHF	290.00	1'606'310.00	0.04	a)
Consumer Staples								800'178'618.60	21.21	
CH0011339204	ASCOM HOLDING AG-REG	85'222	3'851	4'774	84'299	CHF	14.78	1'245'939.22	0.03	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	25'049	10'306	6'526	28'829	CHF	43.38	1'250'602.02	0.03	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	5'516'150	806'164	857'142	5'465'172	CHF	76.83	419'889'164.76	11.13	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1'570'606	244'788	237'243	1'578'151	CHF	341.95	539'648'734.45	14.31	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	26'901	5'316	3'496	28'721	CHF	531.50	15'265'211.50	0.40	a)
CH0012280076	STRAUMANN HOLDING AG-REG	25'244	3'793	3'672	25'365	CHF	1'683.50	42'701'977.50	1.13	a)
CH0012530207	BACHEM HOLDING AG-REG B	11'611	1'771	1'918	11'464	CHF	715.00	8'196'760.00	0.22	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	120'864	18'064	20'222	118'706	CHF	355.20	42'164'371.20	1.12	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	166'794	26'519	25'882	167'431	CHF	701.60	117'469'589.60	3.11	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	9'886	1'720	1'614	9'992	CHF	834.00	8'333'328.00	0.22	a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	9'886	1'703	1'566	10'023	CHF	153.40	1'537'528.20	0.04	a)
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	11'129	0	1'285	9'844	CHF	118.80	1'169'467.20	0.03	a)
CH0027148649	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	21'399	37'182	0	58'581	CHF	1.50	88'105.82	0.00	a)
CH0029850754	ADDEX THERAPEUTICS LTD	14'290	0	0	14'290	CHF	1.45	20'720.50	0.00	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	126'452	16'114	15'770	126'796	CHF	84.15	10'669'883.40	0.28	a)
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	500	37	88	449	CHF	1'975.00	886'775.00	0.02	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd.	Kauf Zugang	Verkauf Abgang	Anz / Nom in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2020	2)	3)	30.09.2021					
CH0100191136	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	1'785'030	3'474'661	771'667	4'488'024	CHF	0.13	603'639.23	0.02	a)
CH0106213793	POLYPHOR AG	19'847	0	0	19'847	CHF	1.85	36'716.95	0.00	a)
CH0187624256	IVF HARTMANN HOLDING AG-REG	850	0	0	850	CHF	145.00	123'250.00	0.00	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	53'150	6'858	2'829	57'179	CHF	18.22	1'041'801.38	0.03	a)
CH0325814116	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	18'568	6'963	0	25'531	CHF	2.43	62'040.33	0.00	a)
CH0346177709	OBSEVA SA	54'375	93'646	0	148'021	USD	3.15	435'181.73	0.01	a)
CH0360674466	GALENICA AG	112'594	18'887	16'207	115'274	CHF	65.90	7'596'556.60	0.20	a)
CH0363463438	IDORSIA LTD	208'404	101'044	60'499	248'949	CHF	22.58	5'621'268.42	0.15	a)
CH0364749348	VIFOR PHARMA AG	106'529	14'404	15'537	105'396	CHF	121.50	12'805'614.00	0.34	a)
CH0386200239	MEDARTIS HOLDING AG	10'257	700	597	10'360	CHF	108.80	1'127'168.00	0.03	a)
CH0432492467	ALCON INC	1'100'051	190'123	168'191	1'121'983	CHF	76.04	85'315'587.32	2.26	a)
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	14'425	516	1'106	13'835	CHF	145.40	2'011'609.00	0.05	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	0	21'046	0	21'046	CHF	120.40	2'533'938.40	0.07	a)
CH1129677105	MEDMIX AG	0	38'688	0	38'688	CHF	44.00	1'702'272.00	0.05	a)
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	41'157	0	0	41'157	CHF	2.07	84'989.21	0.00	a)
IT0005108359	CASSIOPEA SPA	11'562	1'600	0	13'162	CHF	35.70	469'883.40	0.01	a)
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	14'326	8'170	3'620	18'876	CHF	80.50	1'519'518.00	0.04	a)
Health Care								1'333'629'192.34	35.36	
CH0001307757	BANK LINTH LLB AG-REG	217	0	0	217	CHF	515.00	111'755.00	0.00	a)
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	181	0	0	181	CHF	5'240.00	948'440.00	0.03	a)
CH0001340204	GRAUBUENDNER KANTONALBANK-PC	1'643	0	0	1'643	CHF	1'535.00	2'522'005.00	0.07	a)
CH0001341608	HYPOTHEKARBANK LENZBURG-REG	143	0	0	143	CHF	4'240.00	606'320.00	0.02	a)
CH0001473559	BASELLANDS KANTONALBANK-CERT	1'462	0	0	1'462	CHF	920.00	1'345'040.00	0.04	a)
CH0009236461	BASLER KANTONALBK - PC	15'249	0	1'424	13'825	CHF	60.80	840'560.00	0.02	a)
CH0009691608	BERNER KANTONALBANK AG-REG	11'376	1'432	833	11'975	CHF	207.50	2'484'812.50	0.07	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	24'418	5'506	5'559	24'365	CHF	173.00	4'215'145.00	0.11	a)
CH0010947627	AIRENIS-REG	30'036	0	0	30'036	CHF	0.72	21'625.92	0.00	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	335'745	51'840	50'359	337'226	CHF	383.60	129'359'893.60	3.43	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	6'805	1'367	685	7'487	CHF	416.00	3'114'592.00	0.08	a)
CH0011693600	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	7'911	1'575	1'303	8'183	CHF	418.00	3'420'494.00	0.09	a)
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	4'879'464	1'929'951	870'831	5'938'584	CHF	9.29	55'193'199.70	1.46	a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	61'706	15'483	14'287	62'902	CHF	78.75	4'953'532.50	0.13	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	103'149	13'563	13'754	102'958	CHF	142.30	14'650'923.40	0.39	a)
CH0014345117	COMPAGNIE FINANCIERE TRAD-BR	3'288	43	0	3'331	CHF	111.50	371'406.50	0.01	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	37'231	10'039	7'608	39'662	CHF	88.90	3'525'951.80	0.09	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	71'420	11'267	11'949	70'738	CHF	473.50	33'494'443.00	0.89	a)
CH0021545667	VAUDOISE ASSURANCES HOL	2'795	933	769	2'959	CHF	450.00	1'331'550.00	0.04	a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	186'998	37'636	9'778	214'856	CHF	6.76	1'452'426.56	0.04	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	50'852	7'559	7'430	50'981	CHF	1'466.50	74'763'636.50	1.98	a)
CH0028422100	BELLEVUE GROUP AG	22'764	4'584	4'759	22'589	CHF	39.30	887'747.70	0.02	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	497'193	65'605	70'211	492'587	CHF	62.32	30'698'021.84	0.81	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	338'621	0	7'975	330'646	CHF	1.70	562'098.20	0.01	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	644'911	102'549	101'282	646'178	CHF	80.14	51'784'704.92	1.37	a)
CH0189396655	GLARNER KANTONALBANK	7'115	0	0	7'115	CHF	28.20	200'643.00	0.01	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	23'484	3'537	2'981	24'040	CHF	57.10	1'372'684.00	0.04	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	66'741	15'383	13'049	69'075	CHF	62.90	4'344'817.50	0.12	a)
CH0231351104	THURGAUER KANTONALBANK-CERT	6'579	0	0	6'579	CHF	106.50	700'663.50	0.02	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	7'998'700	1'180'316	1'432'358	7'746'658	CHF	15.00	116'199'870.00	3.08	a)
CH0305951201	WALLISER KANTONALBANK-REG	10'155	0	0	10'155	CHF	100.50	1'020'577.50	0.03	a)
CH0350494719	BANQUE CANTONALE DE GENEV-BR	2'730	0	0	2'730	CHF	167.00	455'910.00	0.01	a)
CH0350665672	BANQUE CANTONALE DU JURA-REG	867	0	0	867	CHF	52.50	45'517.50	0.00	a)
CH0367427686	VALARTIS GROUP AG-BR	2'282	0	0	2'282	CHF	9.15	20'880.30	0.00	a)
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	77'096	9'462	7'638	78'920	CHF	101.90	8'041'948.00	0.21	a)
CH0493891243	ZUGER KANTONALBANK-BR	344	0	0	344	CHF	6'700.00	2'304'800.00	0.06	a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	37'027	9'734	9'205	37'556	CHF	92.90	3'488'952.40	0.09	a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	63'971	11'545	9'839	65'677	CHF	71.10	4'669'634.70	0.12	a)
LI0315487269	VP BANK AG-A	6'893	5'710	3'473	9'130	CHF	94.20	860'046.00	0.02	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2) 4'429	Verkauf Abgang 3) 6'579	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	29'941	4'429	6'579	27'791	CHF	52.80	1'467'364.80	0.04	a)
Financials								567'854'634.84	15.05	
AT0000A18XM4	AMS AG	584'422	121'180	90'051	615'551	CHF	17.06	10'498'222.31	0.28	a)
CH0005319162	ELMA ELECTRONIC AG-REG	117	0	0	117	CHF	660.00	77'220.00	0.00	a)
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	4'269	0	0	4'269	CHF	57.00	243'333.00	0.01	a)
CH0009062099	SCHAFFNER HOLDING AG-REG	829	0	0	829	CHF	282.00	233'778.00	0.01	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	3'867	574	444	3'997	CHF	1'096.00	4'380'712.00	0.12	a)
CH0011115703	CREALOGIX HOLDING AG-REG	1'365	0	0	1'365	CHF	120.50	164'482.50	0.00	a)
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	113'177	0	2'500	110'677	CHF	3.92	433'853.84	0.01	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	147'828	19'918	18'227	149'519	CHF	127.10	19'003'864.90	0.50	a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	1'338	163	218	1'283	CHF	2'170.00	2'784'110.00	0.07	a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	14'172	2'239	2'234	14'177	CHF	270.00	3'827'790.00	0.10	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	387'418	55'574	53'979	389'013	CHF	83.26	32'389'222.38	0.86	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	15'942	1'225	0	17'167	CHF	61.85	1'061'778.95	0.03	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	4'811'646	1'272'644	639'988	5'444'302	CHF	0.42	2'301'850.89	0.06	a)
CH0314029270	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	52'981	83'717	0	136'698	CHF	1.19	162'670.62	0.00	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	17'450	6'727	6'584	17'593	CHF	324.00	5'700'132.00	0.15	a)
CH0371153492	LANDIS+GYR GROUP AG	48'518	6'951	7'191	48'278	CHF	60.40	2'915'991.20	0.08	a)
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	24'267	7'489	7'294	24'462	CHF	113.60	2'778'883.20	0.07	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	214'735	44'617	24'715	234'637	CHF	20.55	4'821'790.35	0.13	a)
Information Technology								93'779'686.14	2.49	
CH0025607331	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	488	0	0	488	CHF	1'290.00	629'520.00	0.02	a)
CH0130293662	BKW AG	46'203	7'277	7'628	45'852	CHF	101.00	4'631'052.00	0.12	a)
Utilities								5'260'572.00	0.14	
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	468	0	0	468	CHF	2'440.00	1'141'920.00	0.03	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	171'715	24'214	26'005	169'924	CHF	91.40	15'531'053.60	0.41	a)
CH0008837566	ALLREAL HOLDING AG-REG	33'853	6'097	6'607	33'343	CHF	185.00	6'168'455.00	0.16	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	15'314	2'913	2'752	15'475	CHF	310.50	4'804'987.50	0.13	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	105'108	16'129	18'847	102'390	CHF	112.60	11'529'114.00	0.31	a)
CH0032816131	SF URBAN PROPERTIES AG	3'347	0	0	3'347	CHF	100.00	334'700.00	0.01	a)
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	0	5'025	0	5'025	CHF	20.20	101'505.00	0.00	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	13'598	21'164	1'350	33'412	CHF	61.20	2'044'814.40	0.05	a)
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	774	0	0	774	CHF	1'980.00	1'532'520.00	0.04	a)
CH0239518779	HIAG IMMOBILIEN AG	7'286	1'286	0	8'572	CHF	100.00	857'200.00	0.02	a)
CH0273774791	INTERSHOP HOLDING AG	2'974	393	629	2'738	CHF	581.00	1'590'778.00	0.04	a)
CH0284142913	PLAZZA AG-REG A	3'206	0	0	3'206	CHF	336.00	1'077'216.00	0.03	a)
CH0305285295	VARIA US PROPERTIES AG	4'150	0	0	4'150	CHF	40.20	166'830.00	0.00	a)
CH0312309682	ZUEBLIN IMMOBILIEN HOLDI-REG	5'060	0	0	5'060	CHF	27.60	139'656.00	0.00	a)
CH0325094297	INVESTIS HOLDING SA	8'148	948	0	9'096	CHF	105.50	959'628.00	0.03	a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	13'361	7'409	4'651	16'119	CHF	18.60	299'813.40	0.01	a)
Real Estate								48'280'190.90	1.28	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	56'569	9'253	8'606	57'216	CHF	537.40	30'747'878.40	0.82	a)
CH0011178255	TX GROUP AG	8'370	0	400	7'970	CHF	154.00	1'227'380.00	0.03	a)
CH0019107025	APG SGA SA	3'711	0	372	3'339	CHF	215.50	719'554.50	0.02	a)
CH0039542854	MCH GROUP AG	5'061	4'338	0	9'399	CHF	12.75	119'837.25	0.00	a)
CH0267291224	SUNRISE COMMUNICATIONS GROUP	72'095	0	72'095	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	10'615	0	0	10'615	CHF	3.10	32'906.50	0.00	a)
Diverse								32'847'556.65	0.87	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								0.00	0.00	
CH1110994071	3.0000 % CS 3 11/12/21 B	0	1'818	1'818	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
Diverse								0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Bezugsrechte								0.00	0.00	
CH0549239116	MCH GROUP AG-RTS	0	5'061	5'061	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0566355902	KURO BZR 19.10.20	0	18'568	18'568	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0567481756	DUFREY BZR 19.10.20	0	84'046	84'046	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0572852298	IDORSIA LTD-RIGHTS	0	208'404	208'404	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0582581754	MCH GR BZR 04.12.20	0	5'061	5'061	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0587069664	SWISS STEEL HOLDING AG-RTS	0	986'977	986'977	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1111011453	CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	0	4'933'219	4'933'219	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
Diverse								0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente								0.00	0.00	
Optionen und Optionsscheine								0.00	0.00	
11/23	CIE FINANCIERE RICHEMO-CW	0	2'165'392	2'165'392	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
Optionen										
Futures								0.00	0.00	
12/20	SWISS MKT IX FUTR DEC20	209	209	418	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/20	SWISS MID CAP FUT DEC20	114	0	114	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/21	SWISS MKT IX FUTR MAR21	0	360	360	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/21	SWISS MID CAP FUT MAR21	0	114	114	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/21	SWISS MKT IX FUTR JUN21	0	507	507	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/21	SWISS MID CAP FUT JUN21	0	140	140	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/21	SWISS MKT IX FUTR SEP21	0	351	351	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/21	SWISS MID CAP FUT SEP21	0	119	119	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/21	SWISS MKT IX FUTR DEC21	0	188	32	156	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
12/21	SWISS MID CAP FUT DEC21	0	91	0	91	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
Vermögensaufstellung								Kurswert CHF	in % 7)	
Bankguthaben auf Sicht								3'741'243.15	0.10	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								3'747'942'797.82	99.36	
Sonstige Vermögenswerte								20'307'882.26	0.54	
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode								3'771'991'923.23	100.00	
Andere Verbindlichkeiten								-246'656.21		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode								3'771'745'267.02		
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);							3'747'942'797.82	99.36	
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	
Umrechnungskurse										
EUR	1 = CHF	1.08112650								
USD	1 = CHF	0.93285000								

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	21'160'697.48	0.56
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	0.00	0.00

* Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Ausgabespesen in % des Nettoinventar- wertes	Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Rücknahme- spesen in % des Nettoinventar- wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.10.2020 – 30.09.2021	0.00 - 0.02	0.00	0.007	0.00 - 0.02	0.00	0.006

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 4 geregelt.

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten: 0.00

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten: 0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements: Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission wird verwendet fur die Leitung, die Entschadigung der Depotbank (PAF) fur die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch fur das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermogens.

Im Geschaftsjahr effektiv belastete Satze:

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF
ASTT	01.10.2020 –30.09.2021	0.16 %	0.11 %	0.05 %
DA	01.10.2020 –30.09.2021	0.16 %	0.11 %	0.05 %
DT	01.10.2020 –30.09.2021	0.16 %	0.11 %	0.05 %
FA	01.10.2020 –30.09.2021	0.19 %	0.09 %	0.10 %
GT	01.10.2020 –30.09.2021	0.14 %	0.09 %	0.05 %
NT	01.10.2020 –30.09.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Gemass Richtlinie fur Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebuhren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): Aus der pauschalen Verwaltungskommission konnen Gebuhren bzw. Entschadigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstatigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstatigkeit gilt insbesondere jede Tatigkeit 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 Gebuhren bzw. Kosten gewahren.

Benchmark

SPI®

TER

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

Ausschuttung des Nettoertrags 2020 / 2021

Ex Datum: 18.01.2022

Zahlbar: 21.01.2022

			Ausschuttung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fahig	Wahrung	Brutto je Anteil	Abzuglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
DA	Nein	CHF	4.00	1.40	2.60
FA	Nein	CHF	3.80	1.33	2.47

Thesaurierung des Nettoertrags 2020 / 2021

Ex Datum: 18.01.2022

Zahlbar: 21.01.2022

			Thesaurierung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
ASTT	Nein	CHF	3.095	0.000	3.095
DT	Nein	CHF	3.055	1.069	1.986
GT	Nein	CHF	4.403	1.541	2.862
NT	Nein	CHF	4.763	1.667	3.096

Erklärung der Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / 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
- 18) Einführung Zweitwährung CHF per 30.04.2019
- 23) Anpassung der Nachkommastellen von 2 auf 4 per 13.02.2019

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 gemäss § 21 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern 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 Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Bericht der Prüfungsgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfungsgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund III

mit den Teilvermögen

- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (II)
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund EMU
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund United Kingdom
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund MSCI® World ex Switzerland

bestehend aus den Vermögensrechnungen und den Erfolgsrechnungen, 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) für das am 30. September 2021 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnungen, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern sind. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfungsgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnungen abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnungen frei von wesentlichen falschen Angaben sind.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in den Jahresrechnungen enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in den Jahresrechnungen als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnungen von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnungen. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entsprechen die Jahresrechnungen für das am 30. September 2021 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhängigkeit gemäss Revisionsaufsichtsgesetz erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 27. Januar 2022