

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

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

**Jahresbericht per 28. Februar 2022**

---

<b>Inhaltsverzeichnis</b>	<b>Seite</b>
Organisation und Verwaltung .....	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I.....	12
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung.....	12
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte .....	12
Pauschale Verwaltungskommission.....	13
Benchmark.....	13
TER.....	13
Ausschüttung des Nettoertrags 2021 / 2022 .....	13
Thesaurierung des Nettoertrags 2021 / 2022.....	14
Erklärung der Fussnoten .....	14
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte .....	15
Pflichtpublikationen.....	16
Bericht der Prüfgesellschaft.....	27

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

**Swisscanto Fondsleitung AG**

Zürich, 29.06.2022

## Organisation und Verwaltung

---

### Fondsleitung

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

### Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident  
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,  
Services & Directbanking, 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

### Geschäftsführung

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 SMALL & MID CAPS SWITZERLAND

Übersicht	von	01.03.2021	01.03.2020	01.03.2019	01.03.2018
	bis	28.02.2022	28.02.2021	29.02.2020	28.02.2019
<b>Konsolidiert</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'341'578'412.05	1'068'048'737.43	809'118'289.82	606'208'128.12
<b>Klasse ASTT</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		-	-	-	0.72
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		-	-	-	0.006
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		-	-	-	120.0000
Thesaurierung je Anteil		-	-	-	1.67
Total Expense Ratio (TER)		-	-	-	0.24 %
<b>Klasse DT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'112'517.19	8'727'247.50	16'940'408.15	12'725'244.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		28'049.322	28'277.000	65'477.038	52'537.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		324.8748	308.6341	258.7229	242.2149
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		315.2643	280.8697	243.3324	213.5221
Thesaurierung je Anteil		3.89	4.35	3.74	3.36
Total Expense Ratio (TER)		0.24 %	0.24 %	0.24 %	0.24 %
<b>Klasse FA CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		48'421'710.11	36'427'147.57	42'427'257.84	73'369'062.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		295'559.616	232'304.018	319'366.300	585'106.830
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		163.8306	156.8081	132.8483	125.3943
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		158.9842	142.7018	124.9456	110.5401
Ausschüttung je Anteil		2.00	2.00	2.00	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.30 %	0.30 %	0.30 %	0.30 %
<b>Klasse GT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		345'616'463.42	294'659'934.71	210'837'065.13	68'620'000.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'106'205.329	1'890'863.179	1'614'492.048	561'457.854
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		164.0944	155.8336	130.5903	122.2175
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		159.2401	141.8149	122.8220	107.7396
Thesaurierung je Anteil		2.05	2.26	1.95	1.76
Total Expense Ratio (TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
<b>Klasse MT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'142'459.30	9'962'263.30	5'884'041.06	5'499'965.93
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		146'551.105	63'768.954	45'000.000	45'000.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		164.7375	156.2243	130.7565	122.2215
Thesaurierung je Anteil		2.39	2.53	2.20	2.00
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse NT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		914'285'262.03	718'272'144.35	533'029'517.64	445'993'854.74
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'748'297.874	2'276'747.097	2'018'657.112	1'806'990.237
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		332.6733	315.4817	264.0515	246.8159
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		322.8321	287.1013	248.3440	217.5780
Thesaurierung je Anteil		4.84	5.11	4.45	4.04
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.

<b>Performance</b>	<b>YTD / 28.02.2022</b>	<b>2021</b>	<b>2020</b>	<b>2019</b>
Klasse ASTT (Schliessung 01.03.2019)	-	-	-	12.33 %
Klasse DT CHF	-11.25 %	21.92 %	7.84 %	30.38 %
Klasse FA CHF	-11.26 %	21.85 %	7.77 %	30.29 %
Klasse GT CHF	-11.25 %	21.98 %	7.89 %	30.44 %
Klasse MT CHF	-11.22 %	22.21 %	8.09 %	30.69 %
Klasse NT CHF	-11.22 %	22.21 %	8.09 %	30.69 %
Benchmark	-11.21 %	22.19 %	8.07 %	30.42 %
Tracking Error *	-	0.04 %	0.10 %	0.62 %

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)

	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Bankguthaben auf Sicht	1'520'360.65	1'263'869.25
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'338'457'817.74	1'064'995'043.31
Sonstige Vermögenswerte	1'663'956.50	1'843'769.67
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'341'642'134.89</b>	<b>1'068'102'682.23</b>
Andere Verbindlichkeiten	-63'722.84	-53'944.80
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>1'341'578'412.05</b>	<b>1'068'048'737.43</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse DT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			28'277.000	65'477.038
Ausgegebene Anteile			3'562.752	3'690.000
Zurückgenommene Anteile			-3'790.430	-40'890.038
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>28'049.322</b>	<b>28'277.000</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse FA CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			232'304.018	319'366.300
Ausgegebene Anteile			101'161.401	120'828.066
Zurückgenommene Anteile			-37'905.803	-207'890.348
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>295'559.616</b>	<b>232'304.018</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse GT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			1'890'863.179	1'614'492.048
Ausgegebene Anteile			533'097.025	516'094.384
Zurückgenommene Anteile			-317'754.875	-239'723.253
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>2'106'205.329</b>	<b>1'890'863.179</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse MT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			63'768.954	45'000.000
Ausgegebene Anteile			82'782.151	18'768.954
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>146'551.105</b>	<b>63'768.954</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse NT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			2'276'747.097	2'018'657.112
Ausgegebene Anteile			668'617.454	460'622.585
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)			-	31'794.984
Zurückgenommene Anteile			-197'066.677	-234'327.584
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>2'748'297.874</b>	<b>2'276'747.097</b>

<b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			1'068'048'737.43	809'118'289.82
Ausbezahlte Ausschüttung			-518'070.61	-679'219.07
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-5'896'078.00	-4'496'975.03
Saldo aus dem Anteilverkehr			225'572'467.86	92'300'007.85
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			54'371'355.37	171'806'633.86
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>1'341'578'412.05</b>	<b>1'068'048'737.43</b>

<b>Erfolgsrechnung</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
<b>Ertrag</b>				
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-18'961.07	-28'213.83
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte			16'916'411.65	16'106'392.15
Erträge der Gratisaktien			0.00	11'101.79
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			4'023'893.69	2'997'149.46
<b>Total Ertrag</b>			<b>20'921'344.27</b>	<b>19'086'429.57</b>
<b>Aufwand</b>				
Reglementarische Vergütungen			-838'289.85	-607'642.54
Sonstige Aufwendungen			0.00	-4'149.94
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-1'407'481.15	-1'753'512.23
<b>Total Aufwand</b>			<b>-2'245'771.00</b>	<b>-2'365'304.71</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			<b>18'675'573.27</b>	<b>16'721'124.86</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			43'649'680.64	24'076'916.98
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip			4'482'434.01	5'255'662.20
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen			176'240.32	113'526.45
<b>Realisierter Erfolg</b>			<b>66'983'928.24</b>	<b>46'167'230.49</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-12'612'572.87	125'639'403.37
<b>Gesamterfolg</b>			<b>54'371'355.37</b>	<b>171'806'633.86</b>

<b>Verwendung des Erfolges</b>	<b>Klasse DT CHF</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Nettoertrag		109'315.02	123'285.09
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>109'315.02</b>	<b>123'285.09</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		38'260.26	43'149.78
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		71'054.76	80'135.31
<b>Total</b>		<b>109'315.02</b>	<b>123'285.09</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>	<b>Klasse FA CHF</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Nettoertrag		563'803.91	500'347.96
Vortrag des Vorjahres		35'820.60	80.67
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>599'624.51</b>	<b>500'428.63</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		591'119.23	464'608.03
Vortrag auf neue Rechnung		8'505.28	35'820.60
<b>Total</b>		<b>599'624.51</b>	<b>500'428.63</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>	<b>Klasse GT CHF</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Nettoertrag		4'331'397.69	4'290'677.61
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>4'331'397.69</b>	<b>4'290'677.61</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		1'515'989.19	1'501'737.16
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		2'815'408.50	2'788'940.45
<b>Total</b>		<b>4'331'397.69</b>	<b>4'290'677.61</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>	<b>Klasse MT CHF</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Nettoertrag		351'708.57	161'517.47
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>351'708.57</b>	<b>161'517.47</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		123'098.00	56'531.11
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		228'610.57	104'986.36
<b>Total</b>		<b>351'708.57</b>	<b>161'517.47</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>	<b>Klasse NT CHF</b>	<b>28.02.2022</b>	<b>28.02.2021</b>
Nettoertrag		13'319'348.08	11'645'296.73
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>13'319'348.08</b>	<b>11'645'296.73</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		4'661'771.83	4'075'853.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		8'657'576.25	7'569'442.87
<b>Total</b>		<b>13'319'348.08</b>	<b>11'645'296.73</b>

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>								<b>1'338'457'817.74</b>	<b>99.76</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>								<b>1'338'457'817.74</b>	<b>99.76</b>	
AT0000A18XM4	AMS-OSRAM AG	920'947	227'306	49'098	1'099'155	CHF	14.34	15'761'882.70	1.17	a)
AT0000KTM102	PIERER MOBILITY AG	27'308	10'920	439	37'789	CHF	84.60	3'196'949.40	0.24	a)
<b>AT</b>								<b>18'958'832.10</b>	<b>1.41</b>	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	674'816	148'358	38'380	784'794	CHF	8.20	6'435'310.80	0.48	a)
CH0001307757	BANK LINTH LLB AG-REG	299	0	0	299	CHF	600.00	179'400.00	0.01	a)
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	281	107	13	375	CHF	7'320.00	2'745'000.00	0.20	a)
CH0001340204	GRAUBUENDNER KANTONALBANK-PC	2'703	0	0	2'703	CHF	1'665.00	4'500'495.00	0.34	a)
CH0001341608	HYPOTHEKARBANK LENZBURG-REG	130	0	0	130	CHF	4'220.00	548'600.00	0.04	a)
CH0001473559	BASELLANDS KANTONALBANK-CERT	2'114	191	0	2'305	CHF	926.00	2'134'430.00	0.16	a)
CH0001503199	BELIMO HOLDING AG-REG	1'675	41	1'716	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0001624714	CPH CHEMIE & PAPIER HLDG-REG	3'980	4'454	0	8'434	CHF	64.80	546'523.20	0.04	a)
CH0001752309	FISCHER (GEORG)-REG	13'753	3'543	885	16'411	CHF	1'135.00	18'626'485.00	1.39	a)
CH0002088976	VALORA HOLDING AG-REG	12'811	2'994	0	15'805	CHF	181.80	2'873'349.00	0.21	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	198'326	50'962	10'449	238'839	CHF	35.40	8'454'900.60	0.63	a)
CH0002187810	PHOENIX MECANO AG-BR	2'178	0	0	2'178	CHF	387.00	842'886.00	0.06	a)
CH0002361068	STARRAG GROUP HOLDING AG	2'115	0	0	2'115	CHF	48.00	101'520.00	0.01	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	22'412	5'447	884	26'975	CHF	407.80	11'000'405.00	0.82	a)
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	607	0	0	607	CHF	2'390.00	1'450'730.00	0.11	a)
CH0003245351	VON ROLL HOLDING AG-BR	480'271	0	0	480'271	CHF	1.09	521'094.04	0.04	a)
CH0003420806	ORELL FUSSLI HOLDING AG-REG	4'466	0	0	4'466	CHF	89.80	401'046.80	0.03	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	3'931	1'056	607	4'380	CHF	1'576.00	6'902'880.00	0.51	a)
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	12'255	2'985	3'957	11'283	CHF	163.40	1'843'642.20	0.14	a)
CH0005319162	ELMA ELECTRONIC AG-REG	131	0	0	131	CHF	685.00	89'735.00	0.01	a)
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	1'799'799	2'320'064	1'445'367	2'674'496	CHF	0.30	795'662.56	0.06	a)
CH0006089921	PRIVATE EQUITY HLDG-REG	3'000	0	0	3'000	CHF	83.00	249'000.00	0.02	a)
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	2'311	521	75	2'757	CHF	3'410.00	9'401'370.00	0.70	a)
CH0008012236	GURIT HOLDING AG-BR	1'098	343	136	1'305	CHF	1'514.00	1'975'770.00	0.15	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	254'966	60'343	11'603	303'706	CHF	90.15	27'379'095.90	2.04	a)
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	5'985	968	0	6'953	CHF	49.30	342'782.90	0.03	a)
CH0008837566	ALLREAL HOLDING AG-REG	48'692	15'907	1'893	62'706	CHF	199.00	12'478'494.00	0.93	a)
CH0008967926	ADVAL TECH HOLDING AG-REG	363	0	0	363	CHF	166.00	60'258.00	0.00	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	10'146	4'562	399	14'309	CHF	2'120.00	30'335'080.00	2.26	a)
CH0009062099	SCHAFFNER HOLDING AG-REG	1'192	333	0	1'525	CHF	335.00	510'875.00	0.04	a)
CH0009115129	PERFECT HOLDING SA	263'666	0	0	263'666	CHF	0.07	18'324.79	0.00	a)
CH0009236461	BASLER KANTONALBK - PC	21'671	5'301	808	26'164	CHF	66.00	1'726'824.00	0.13	a)
CH0009320091	FEINTOOL INTL HOLDING-REG	8'310	1'429	501	9'238	CHF	51.60	476'680.80	0.04	a)
CH0009691608	BERNER KANTONALBANK AG-REG	16'142	5'980	312	21'810	CHF	216.50	4'721'865.00	0.35	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	365	90	20	435	CHF	103'500.00	45'022'500.00	3.36	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	3'449	988	170	4'267	CHF	9'775.00	41'709'925.00	3.11	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	35'684	7'494	685	42'493	CHF	160.20	6'807'378.60	0.51	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	13'133	2'197	268	15'062	CHF	242.40	3'651'028.80	0.27	a)
CH0010754924	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG-BR	3'358	913	172	4'099	CHF	1'188.00	4'869'612.00	0.36	a)
CH0011003594	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-BR	958	573	0	1'531	CHF	270.00	413'370.00	0.03	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	5'966	1'386	231	7'121	CHF	1'082.00	7'704'922.00	0.57	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	22'359	5'969	1'335	26'993	CHF	308.00	8'313'844.00	0.62	a)
CH0011115703	CREALOGIX HOLDING AG-REG	1'686	0	0	1'686	CHF	110.50	186'303.00	0.01	a)
CH0011178255	TX GROUP AG	11'526	3'765	1'097	14'194	CHF	144.20	2'046'774.80	0.15	a)
CH0011339204	ASCOM HOLDING AG-REG	120'904	39'336	0	160'240	CHF	10.42	1'669'700.80	0.12	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	34'199	19'171	1'348	52'022	CHF	38.12	1'983'078.64	0.15	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	10'703	3'307	739	13'271	CHF	450.00	5'971'950.00	0.45	a)
CH0011607683	TORNOS HOLDING AG - REG	21'625	0	0	21'625	CHF	7.75	167'593.75	0.01	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0011693600	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	11'421	4'216	769	14'868	CHF	410.00	6'095'880.00	0.45	a)
CH0011795959	DORMAKABA HOLDING AG	10'207	2'467	455	12'219	CHF	508.00	6'207'252.00	0.46	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	40'348	13'563	2'386	51'525	CHF	397.80	20'496'645.00	1.53	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	547'553	159'885	34'835	672'603	CHF	43.54	29'285'134.62	2.18	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	838'032	208'693	143'651	903'074	CHF	16.59	14'977'482.29	1.12	a)
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	185'299	60'707	19'644	226'362	CHF	54.80	12'404'637.60	0.92	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	0	115'222	0	115'222	CHF	285.10	32'849'792.20	2.45	a)
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	139'610	0	0	139'610	CHF	3.27	456'524.70	0.03	a)
CH0012280076	STRAUMANN HOLDING AG-REG	37'853	9'651	2'181	45'323	CHF	1'459.50	66'148'918.50	4.93	a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	92'924	23'106	4'149	111'881	CHF	72.70	8'133'748.70	0.61	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	155'531	38'954	10'884	183'601	CHF	154.10	28'292'914.10	2.11	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	223'096	57'161	11'395	268'862	CHF	92.62	24'901'998.44	1.86	a)
CH0012530207	BACHEM HOLDING AG-REG B	17'182	8'499	767	24'914	CHF	546.00	13'603'044.00	1.01	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	181'436	41'177	10'351	212'262	CHF	357.00	75'777'534.00	5.65	a)
CH0012684657	BOBST GROUP SA-REG	26'292	7'254	1'095	32'451	CHF	83.60	2'712'903.60	0.20	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	6'909	1'673	408	8'174	CHF	1'071.00	8'754'354.00	0.65	a)
CH0012949464	GROUPE MINOTERIES SA-REG	306	0	0	306	CHF	416.00	127'296.00	0.01	a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	0	31'813	145	31'668	CHF	67.30	2'131'256.40	0.16	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	14'667	4'073	845	17'895	CHF	693.00	12'401'235.00	0.92	a)
CH0014345117	COMPAGNIE FINANCIERE TRAD-BR	5'146	68	0	5'214	CHF	106.50	555'291.00	0.04	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	54'643	17'929	3'405	69'167	CHF	95.50	6'605'448.50	0.49	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	22'964	5'753	1'302	27'415	CHF	908.50	24'906'527.50	1.86	a)
CH0017875789	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG	16'753	6'502	618	22'637	CHF	142.60	3'228'036.20	0.24	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	153'307	36'869	7'518	182'658	CHF	118.80	21'699'770.40	1.62	a)
CH0019107025	APG SGA SA	5'254	507	333	5'428	CHF	193.20	1'048'689.60	0.08	a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	14'033	5'647	1'362	18'318	CHF	161.20	2'952'861.60	0.22	a)
CH0021218067	EVOLVA HOLDING SA	2'781'289	954'062	0	3'735'351	CHF	0.13	496'054.61	0.04	a)
CH0021545667	VAUDOISE ASSURANCES HOL	3'622	1'918	452	5'088	CHF	429.00	2'182'752.00	0.16	a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	276'963	130'623	0	407'586	CHF	7.00	2'853'102.00	0.21	a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	1'913	463	104	2'272	CHF	2'185.00	4'964'320.00	0.37	a)
CH0023405456	DUFREY AG-REG	155'277	117'041	8'850	263'468	CHF	43.31	11'410'799.08	0.85	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	41'689	20'917	7'551	55'055	CHF	23.06	1'269'568.30	0.09	a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	21'462	4'905	1'059	25'308	CHF	247.00	6'251'076.00	0.47	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	137'291	34'917	9'040	163'168	CHF	211.50	34'510'032.00	2.57	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	67'071	22'611	6'484	83'198	CHF	207.00	17'221'986.00	1.28	a)
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	3'172	0	0	3'172	CHF	40.30	127'831.60	0.01	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	188'457	49'319	9'194	228'582	CHF	251.40	57'465'514.80	4.28	a)
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	16'176	4'976	877	20'275	CHF	106.00	2'149'150.00	0.16	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	9'925	2'670	431	12'164	CHF	452.00	5'498'128.00	0.41	a)
CH0025607331	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	832	29	0	861	CHF	1'265.00	1'089'165.00	0.08	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	581'648	54'668	636'316	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0027148649	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	55'394	167'621	41'484	181'531	CHF	1.35	244'703.79	0.02	a)
CH0028422100	BELLEVUE GROUP AG	29'046	9'439	0	38'485	CHF	40.30	1'550'945.50	0.12	a)
CH0029850754	ADDEX THERAPEUTICS LTD	124'940	0	0	124'940	CHF	0.86	107'198.52	0.01	a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	54'270	22'090	5'311	71'049	CHF	88.50	6'287'836.50	0.47	a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	25'421	5'769	973	30'217	CHF	316.50	9'563'680.50	0.71	a)
CH0032816131	SF URBAN PROPERTIES AG	5'736	0	0	5'736	CHF	100.00	573'600.00	0.04	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	23'633	7'007	944	29'696	CHF	65.05	1'931'724.80	0.14	a)
CH0038285679	ORASCOM DEVELOPMENT HOLDING	56'940	0	0	56'940	CHF	10.38	591'037.20	0.04	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	59'088	14'057	3'361	69'784	CHF	77.55	5'411'749.20	0.40	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	187'083	45'126	9'136	223'073	CHF	63.80	14'232'057.40	1.06	a)
CH0039542854	MCH GROUP AG	26'078	0	0	26'078	CHF	9.64	251'391.92	0.02	a)
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	672	202	18	856	CHF	2'000.00	1'712'000.00	0.13	a)
CH0042615283	ZUR ROSE GROUP AG	32'175	10'656	1'613	41'218	CHF	160.60	6'619'610.80	0.49	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	3'359'183	824'716	178'453	4'005'446	CHF	1.05	4'189'696.52	0.31	a)
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	84'290	36'319	0	120'609	CHF	19.55	2'357'905.95	0.18	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0100191136	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	5'558'926	4'833'102	1'316'732	9'075'296	CHF	0.06	571'743.65	0.04	a)
CH0100837282	KARDEX HOLDING AG-REG	20'364	4'872	1'114	24'122	CHF	240.00	5'789'280.00	0.43	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	749'484	177'484	45'471	881'497	CHF	53.80	47'424'538.60	3.53	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	481'367	103'445	0	584'812	CHF	1.15	671'364.18	0.05	a)
CH0106213793	SPEXIS AG	33'228	0	0	33'228	CHF	1.41	46'785.02	0.00	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	7'148'886	2'791'152	331'660	9'608'378	CHF	0.35	3'361'010.62	0.25	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	190'851	53'009	12'563	231'297	CHF	20.35	4'706'893.95	0.35	a)
CH0110303119	LECLANCHE SA-REG	306'769	0	0	306'769	CHF	0.53	162'587.57	0.01	a)
CH0111677362	ORIOR AG	24'221	10'520	4'175	30'566	CHF	84.00	2'567'544.00	0.19	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	34'784	31'896	2'068	64'612	CHF	55.40	3'579'504.80	0.27	a)
CH0122527648	POENINA HOLDING AG	3'148	10'238	0	13'386	CHF	45.20	605'047.20	0.05	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	21'044	5'339	0	26'383	CHF	52.20	1'377'192.60	0.10	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	120'554	32'256	5'222	147'588	CHF	78.55	11'593'037.40	0.86	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	9'436	2'840	476	11'800	CHF	152.90	1'804'220.00	0.13	a)
CH0130293662	BKW AG	69'114	21'147	7'310	82'951	CHF	115.80	9'605'725.80	0.72	a)
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	1'116	288	0	1'404	CHF	1'950.00	2'737'800.00	0.20	a)
CH0187624256	IVF HARTMANN HOLDING AG-REG	880	0	0	880	CHF	125.00	110'000.00	0.01	a)
CH0189396655	GLARNER KANTONALBANK	16'788	0	0	16'788	CHF	28.40	476'779.20	0.04	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	31'714	9'918	1'504	40'128	CHF	62.90	2'524'051.20	0.19	a)
CH0208062627	MEIER TOBLER GROUP AG	17'634	2'083	0	19'717	CHF	16.45	324'344.65	0.02	a)
CH0212186248	NOVAVEST REAL ESTATE AG	19'245	1'749	0	20'994	CHF	46.80	982'519.20	0.07	a)
CH0212255803	BURKHALTER HOLDING AG	18'946	400	475	18'871	CHF	62.20	1'173'776.20	0.09	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	100'032	25'039	4'411	120'660	CHF	63.40	7'649'844.00	0.57	a)
CH0231351104	THURGAUER KANTONALBANK-CERT	13'895	0	0	13'895	CHF	109.00	1'514'555.00	0.11	a)
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	18'952	3'786	469	22'269	CHF	256.50	5'711'998.50	0.43	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	56'846	15'502	4'085	68'263	CHF	134.60	9'188'199.80	0.68	a)
CH0239518779	HIAG IMMOBILIEN AG	12'288	8'429	0	20'717	CHF	94.60	1'959'828.20	0.15	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	4'993	1'263	185	6'071	CHF	1'070.00	6'495'970.00	0.48	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	80'353	39'662	16'863	103'152	CHF	22.40	2'310'604.80	0.17	a)
CH0273774791	INTERSHOP HOLDING AG	3'867	1'700	553	5'014	CHF	614.00	3'078'596.00	0.23	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	32'937	8'680	248	41'369	CHF	79.30	3'280'561.70	0.24	a)
CH0276837694	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	158'488	47'020	6'892	198'616	CHF	13.60	2'701'177.60	0.20	a)
CH0284142913	PLAZZA AG-REG A	5'404	175	0	5'579	CHF	338.00	1'885'702.00	0.14	a)
CH0305285295	VARIA US PROPERTIES AG	17'529	14'008	0	31'537	CHF	52.40	1'652'538.80	0.12	a)
CH0305951201	WALLISER KANTONALBANK-REG	13'220	252	0	13'472	CHF	106.50	1'434'768.00	0.11	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	90'385	22'019	4'645	107'759	CHF	348.40	37'543'235.60	2.80	a)
CH0312309682	ZUEBLIN IMMOBILIEN HOLDI-REG	5'326	0	0	5'326	CHF	26.20	139'541.20	0.01	a)
CH0314029270	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	149'245	115'609	31'093	233'761	CHF	0.59	137'918.99	0.01	a)
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	7'931	2'330	348	9'913	CHF	274.50	2'721'118.50	0.20	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	63'556	17'438	4'277	76'717	CHF	165.00	12'658'305.00	0.94	a)
CH0325094297	INVESTIS HOLDING SA	10'091	5'967	2'037	14'021	CHF	107.00	1'500'247.00	0.11	a)
CH0325814116	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	20'618	0	0	20'618	CHF	2.06	42'473.08	0.00	a)
CH0346177709	OBSEVA SA	209'678	139'874	0	349'552	USD	1.41	452'669.82	0.03	a)
CH0350494719	BANQUE CANTONALE DE GENEV-BR	4'804	0	0	4'804	CHF	163.00	783'052.00	0.06	a)
CH0360674466	GALENICA AG	169'612	44'833	9'433	205'012	CHF	64.80	13'284'777.60	0.99	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	26'179	5'576	738	31'017	CHF	279.00	8'653'743.00	0.65	a)
CH0363463438	IDORSIA LTD	369'649	106'821	27'828	448'642	CHF	18.54	8'317'822.68	0.62	a)
CH0364749348	VIFOR PHARMA AG	158'438	38'674	8'058	189'054	CHF	161.15	30'466'052.10	2.27	a)
CH0371153492	LANDIS+GYR GROUP AG	71'447	18'850	3'717	86'580	CHF	59.95	5'190'471.00	0.39	a)
CH0386200239	MEDARTIS HOLDING AG	14'629	4'984	2'153	17'460	CHF	137.40	2'399'004.00	0.18	a)
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	24'301	0	0	24'301	CHF	2.64	64'154.64	0.00	a)
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	35'951	9'860	2'631	43'180	CHF	104.40	4'507'992.00	0.34	a)
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	13'389	0	0	13'389	CHF	15.45	206'860.05	0.02	a)
CH0435377954	SIG COMBIBLOC GROUP AG	952'027	385'311	48'376	1'288'962	CHF	20.68	26'655'734.16	1.99	a)
CH0453226893	ALUFLEXPACK AG	27'092	6'324	37	33'379	CHF	18.25	609'166.75	0.05	a)
CH0460027110	BLACKSTONE RESOURCES AG	34'327	0	0	34'327	CHF	1.87	64'191.49	0.00	a)
CH0461929603	XLIFE SCIENCES AG	0	1'795	0	1'795	CHF	44.99	80'757.05	0.01	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 28.02.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	116'741	27'815	4'886	139'670	CHF	111.80	15'615'106.00	1.16	a)
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	19'938	5'611	1'633	23'916	CHF	117.00	2'798'172.00	0.21	a)
CH0478634105	AEVIS VICTORIA SA	51'868	0	0	51'868	CHF	15.35	796'173.80	0.06	a)
CH0493891243	ZUGER KANTONALBANK-BR	489	47	0	536	CHF	6'980.00	3'741'280.00	0.28	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	352'616	107'980	10'885	449'711	CHF	16.64	7'483'191.04	0.56	a)
CH0522213468	ACHIKO LTD	300'718	0	0	300'718	CHF	0.08	23'275.57	0.00	a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	21'714	0	0	21'714	CHF	19.46	422'554.44	0.03	a)
CH0527044959	BERGBAHNEN ENGELB. TRUEB-REG	6'095	0	0	6'095	CHF	45.10	274'884.50	0.02	a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	53'554	16'486	3'860	66'180	CHF	82.60	5'466'468.00	0.41	a)
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	44'952	13'756	2'549	56'159	CHF	46.80	2'628'241.20	0.20	a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	96'068	29'426	9'543	115'951	CHF	78.50	9'102'153.50	0.68	a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	9'301	2'082	843	10'540	CHF	105.60	1'113'024.00	0.08	a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	0	11'717	0	11'717	CHF	224.00	2'624'608.00	0.20	a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	0	41'421	1'634	39'787	CHF	488.00	19'416'056.00	1.45	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	0	102'071	616	101'455	CHF	24.50	2'485'647.50	0.19	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	0	60'257	248	60'009	CHF	81.30	4'878'731.70	0.36	a)
CH1129677105	MEDMIX AG	0	105'484	2'611	102'873	CHF	33.96	3'493'567.08	0.26	a)
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	19'312	7'217	4'237	22'292	CHF	39.80	887'221.60	0.07	a)
<b>CH</b>								<b>1'311'848'024.80</b>	<b>97.78</b>	
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	83'167	0	0	83'167	CHF	1.32	109'780.44	0.01	a)
IT0005108359	CASSIOPEA SPA	19'595	0	19'595	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>IT</b>								<b>109'780.44</b>	<b>0.01</b>	
LI0315487269	VP BANK AG-A	11'295	6'998	541	17'752	CHF	98.00	1'739'696.00	0.13	a)
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	41'820	15'818	1'849	55'789	CHF	55.60	3'101'868.40	0.23	a)
<b>LI</b>								<b>4'841'564.40</b>	<b>0.36</b>	
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	23'052	22'808	1'604	44'256	CHF	61.00	2'699'616.00	0.20	a)
<b>NL</b>								<b>2'699'616.00</b>	<b>0.20</b>	
<b>Bezugsrechte</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0587069664	SWISS STEEL HOLDING AG-RTS	0	1'838'274	1'838'274	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0598285952	FUNDAMENTA REAL ESTATE-RTS	0	84'290	84'290	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1117398706	NOVAVEST REAL ESTATE AG	0	19'245	19'245	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1134530455	HIAG IMMOBILIEN HOLDING-RTS	0	14'223	14'223	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1154161538	CICOR TECHNOLOGIES-RTS	0	6'953	6'953	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Futures</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
03/21	SWISS MID CAP FUT MAR21	83	31	114	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/21	SWISS MID CAP FUT JUN21	0	226	226	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/21	SWISS MID CAP FUT SEP21	0	303	303	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/21	SWISS MID CAP FUT DEC21	0	294	294	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/22	SWISS MID CAP FUT MAR22	0	159	26	133	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
<b>Vermögensaufstellung</b>								<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>	
Bankguthaben auf Sicht								1'520'360.65	0.11	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								1'338'457'817.74	99.76	
Sonstige Vermögenswerte								1'663'956.50	0.12	
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>								<b>1'341'642'134.89</b>	<b>100.00</b>	
Andere Verbindlichkeiten								-63'722.84		
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>								<b>1'341'578'412.05</b>		

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswahrung:	CHF

#### Bewertungskategorien

		Kurswert CHF	in % 7)
a)	Anlagen, die an einer Borse 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);	1'338'457'817.74	99.76
b)	Anlagen, fur die keine Kurse gemass Buchstabe a verfugbar 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 Berucksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

#### Umrechnungskurse

EUR	1 = CHF	1.03048376
USD	1 = CHF	0.91745000

## Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens*
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	4'001'822.37	0.30
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 Rücknahmespesen in % des Nettoinventar- wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.03.2021 – 28.02.2022	0.00 - 0.05	0.00	0.028	0.00 - 0.05	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. 3 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 so genannten soft commissions geschlossen.

## Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF	max. PVK p.a.	max. VK Zielfonds p.a.
DT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.24 %	0.19 %	0.05 %	0.40 %	3.00 %
FA CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.30 %	0.20 %	0.10 %	0.50 %	3.00 %
GT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.19 %	0.14 %	0.05 %	0.35 %	3.00 %
MT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	3.00 %
NT CHF	01.03.2021 – 28.02.2022	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	3.00 %

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. 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.

## Benchmark

Swiss Performance Index EXTRA® TR (SPI EXTRA® TR)

## 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.

## Ausschüttung des Nettoertrags 2021 / 2022

Ex Datum: 22.06.2022

Zahlbar: 25.06.2022

			Ausschüttung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	2.00	0.70	1.30

## Thesaurierung des Nettoertrags 2021 / 2022

Ex Datum: 22.06.2022

Zahlbar: 25.06.2022

			Thesaurierung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	3.897	1.363	2.534
GT CHF	Nein	CHF	2.056	0.719	1.337
MT CHF	Nein	CHF	2.399	0.839	1.560
NT CHF	Nein	CHF	4.846	1.696	3.150

## Erklärung der 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

## Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse 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 Kommissionsätze 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.

## Pflichtpublikationen

---

### Mitteilung an die 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 USA**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets**  
**Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund 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) Govt. (I)**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked hedged CHF**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR**  
(neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible)  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD**  
(neu: Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible)  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD**  
**Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency**  
**Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect**  
**Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect**  
**Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect**  
**Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF**  
(nachfolgend "die Teilvermögen")

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

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible sollen künftig als Zielfonds von anderen kollektiven Kapitalanlagen der Swisscanto Fondsleitung AG dienen. Die diesbezüglichen Anpassungen des Fondsvertrages werden unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung aufgeführt.

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

Die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD sollen neu nachhaltig ausgerichtet werden, was mit einer Änderung der Anlagepolitik und mit einer Änderung der Bezeichnung dieser beiden Teilvermögen verbunden ist (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfährt die Anlagepolitik in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible Anpassungen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Weiter wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. eine Bestimmung betreffend die anteilige Kürzung von Rücknahmeanträgen (Gating) aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Des Weiteren wird bei diversen Teilvermögen eine Ergänzung betreffend die Einhaltung der Aktienfonds-Kapitalbeteiligungsquote bei Investitionen in Zielfonds vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

Zudem wird beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate eine Anpassung betreffend den Referenzindex vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 6 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird der Hinweis wonach das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan als Zielfonds fungiert, gestrichen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 7 dieser Veröffentlichung).

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

## **1. Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible als Zielfonds**

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. dient als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlagen:

- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V);
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V);
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (im Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V);
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (II) (Anlagefonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible dient als Zielfonds für folgende kollektive Kapitalanlage:

- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF (im Umbrella-Fonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" Swisscanto (CH) Index Fund II mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds).

Diesbezüglich werden in § 1 Ziff. 5, § 8 Ziff. 19 und Ziff. 24, § 15 Ziff. 21 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate, Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) und Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF zudem neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen dieser Teilvermögen bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführten investierenden kollektiven Kapitalanlagen, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. bzw. das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible als Zielfonds fungieren, sollen gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des jeweiligen Zielfonds erwerben können (vgl. dazu für die Teilvermögen im vorliegenden Umbrella-Fonds die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des jeweiligen Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgeblichen investierenden kollektiven Kapitalanlagen, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den jeweiligen Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 21 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

## **2. Änderung der Anlagepolitik bezüglich Einführung einer Nachhaltigkeitspolitik sowie Anpassung der Bezeichnung bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD**

### **2.1 Nachhaltigkeitspolitik**

In § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR) bzw. in § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD) wird neu statuiert, dass der Vermögensverwalter für das jeweilige Teilvermögen das Anlageuniversum der Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR) bzw. gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD) basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise (ESG-Kriterien: Environment, Social, Governance) einschränkt.

Der Vermögensverwalter stützt sich dabei auf Daten von Drittanbietern sowie auf eigene Analysen (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

Die Reduktion des Anlageuniversums erfolgt durch Ausschlüsse und durch die Identifikation von Titeln, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien schlecht abschneiden (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

Der Vermögensverwalter richtet die Portfoliokonstruktion zudem auf eine Reduktion des CO<sub>2</sub>-Ausstosses aus (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

In § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD wird sodann auch das Ziel der Nachhaltigkeitspolitik angegeben.

Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik (vgl. § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages i.V.m. Ziff. 1.2.1 Bst. 23) des Prospektes betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR bzw. § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages i.V.m. Ziff. 1.2.1 Bst. 24) des Prospektes betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD).

## 2.2 Bezeichnung der Teilvermögen

Infolge der Änderung der Anlagepolitik (vgl. Ausführung in vorstehender Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung) wird die Bezeichnung der Teilvermögen wie folgt geändert:

Bezeichnung bisher:	Bezeichnung neu:
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD	Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible

Die Bezeichnung der Teilvermögen wird im Fondsvertrag entsprechend angepasst (vgl. Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 6 Ziff. 4, Titel oberhalb von § 8 Ziff. 25, Titel oberhalb von § 8 Ziff. 26, § 10 Ziff. 2, § 11 Ziff. 2, § 15 Ziff. 3, § 15 Ziff. 21, § 21 Ziff. 1 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

## 3. Änderung der Anlagepolitik in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

In § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible), in § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible) und in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible) werden die Angaben zur Nachhaltigkeitspolitik überarbeitet (Umformulierungen und Ergänzung von Angaben zu den Zielen der Nachhaltigkeitspolitik).

In Ziff. 1.2.1 Bst. 2) des Prospektes (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible), in Ziff. 1.2.1 Bst. 10) des Prospektes (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible) und in Ziff. 1.2.1 Bst. 12) des Prospektes (Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible) finden sich neu detailliertere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik (insbesondere zur angewandten Methodik, zu den verwendeten Daten und zu den massgeblichen Ausschlusskriterien).

## 4. Aufnahme von Gatingbestimmungen betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. wird eine neue Bestimmung aufgenommen (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages), in welcher ausgeführt wird, dass sich die Fondsleitung unter ausserordentlichen Umständen im Interesse der im betreffenden Teilvermögen verbleibenden Anleger, die anteilige Kürzung aller Rücknahmeanträge (Gating) an Bewertungstagen vorbehält, an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto 15% des Fondsvermögens übersteigt. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages). Dabei gilt, dass der verbleibende Teil der Rücknahmeanträge als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten ist und zu den an diesem Bewertungstag geltenden Bedingungen abgewickelt wird (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages). Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge stattfindet (vgl. neue Ziff. 8 in § 17 des Fondsvertrages). Zudem wird in der neu hinzugefügten Ziff. 9 von § 17 des Fondsvertrages diesbezüglich festgehalten, dass die Fondsleitung den Entscheid über die Einführung und Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mitteilt.

## 5. Ergänzung betreffend die Einhaltung der Aktienfonds-Kapitalbeteiligungsquote bei Investitionen in Zielfonds

Bei den nachfolgend aufgeführten Teilvermögen werden wie bisher mindestens 51% der Aktiven des jeweiligen Teilvermögens entweder direkt in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte oder in solche kollektive Kapitalanlagen, welche als Aktienfonds gemäss deutschem Steuerrecht qualifizieren (nachfolgend "Ziel-Investmentfonds"), investiert (vgl. die beim jeweiligen Teilvermögen nachfolgend angegebene Fondsvertragsbestimmung).

Neu wird im Fondsvertrag diesbezüglich darauf hingewiesen, dass für die Einhaltung der Aktienfonds-Kapitalbeteiligungsquote auf die bewertungstäglich von den Ziel-Investmentfonds veröffentlichten tatsächlichen Kapitalbeteiligungsquoten abgestellt wird (vgl. die Ergänzung in der beim jeweiligen Teilvermögen nachfolgend angegebenen Fondsvertragsbestimmung).

– **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I):**  
vgl. § 8 Ziff. 3 des Fondsvertrages

- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible:**  
vgl. § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland:**  
vgl. § 8 Ziff. 5 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH:**  
vgl. § 8 Ziff. 6 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA:**  
vgl. § 8 Ziff. 7 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan:**  
vgl. § 8 Ziff. 8 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan:**  
vgl. § 8 Ziff. 9 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada:**  
vgl. § 8 Ziff. 10 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH:**  
vgl. § 8 Ziff. 11 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible:**  
vgl. § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages
- **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets:**  
vgl. § 8 Ziff. 13 des Fondsvertrages

**6. Anpassung der Angaben betreffend Referenzindex beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate**

In § 8 Ziff. 20 des Fondsvertrages, in Ziff. 1.2.1.18 des Prospektes sowie in der Tabelle zum Prospekt werden die Angaben betreffend den Referenzindex des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate wie folgt angepasst:

Referenzindex bisher	Referenzindex neu
Bloomberg Barclays Global Aggregate Bond ex CHF Index	Bloomberg Global Aggregate Bond ex CHF Index

**7. Streichung des Hinweises betreffend Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan als Zielfonds des Teilvermögens Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World ex CH des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I)**

Betreffend das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan wird der folgende Hinweis in § 8 Ziff. 8 des Fondsvertrages gelöscht:

*"Dieses Teilvermögen dient auch als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World ex CH des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I) (Dachfonds). Dieser Dachfonds darf gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile dieses Zielfonds erwerben. Bezüglich der damit zusammenhängenden Risiken wird auf § 15 Ziff. 21 verwiesen."*

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Ziff. 1, Ziff. 2, Ziff. 3, Ziff. 4, Ziff. 5, Ziff. 6 und Ziff. 7 der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt, soweit diese Änderungen Bestimmungen nach Art. 35a Abs. 1 Bst. a – g KKV betreffen.

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die "Wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger" (KIIDs) sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.  
Zürich, 16. August 2021

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anleger

des

### Swisscanto (CH) Index Fund V

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

(nachfolgend „der Umbrella-Fonds“)

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.

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

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

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

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

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency

Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect

Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect

Swisscanto (CH) Index Commodity Fund hedged CHF

(nachfolgend „die Teilvermögen“)

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

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

Im Fondsvertrag wird neu explizit festgehalten, dass das als Dachfonds ausgestaltete Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible in Zielfonds dieses Umbrella-Fonds investiert (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Als dann erfolgen wenige Ergänzungen im Fondsvertrag im Zusammenhang mit den bereits bestehenden Möglichkeiten der Sacheinlage (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Ferner erfolgt eine Ergänzung bei den Angaben zu den Kosten für den An- und Verkauf der Anlagen, welche dem Fondsvermögen belastet werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

Überdies wird die Umschreibung des Anlegerkreises der Anteilsklassen C, D, G, M und N angepasst (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Abschliessend erfährt die Anlagepolitik von sechs Teilvermögen des Umbrella-Fonds in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik Anpassungen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 5 dieser Veröffentlichung).

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

### 1. Investitionen eines Dachfonds in Zielfonds innerhalb des Umbrella-Funds

Es wird neu explizit festgehalten, dass das in diesem Umbrella-Fonds enthaltene Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible, welches als Dachfonds ausgestaltet ist, u.a. in die Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible dieses Umbrella-Fonds investiert (vgl. § 1 Ziff. 5., § 8 Ziff. 25 und Ziff. 26, § 15 Ziff. 21 und § 26 Ziff. 1).

### 2. Ergänzung Sacheinlage

Bis anhin war in § 5 Ziff. 4 des Fondsvertrages lediglich festgehalten, dass die Anleger zur Einzahlung des von ihnen gezeichneten Anteils in das entsprechende Teilvermögen verpflichtet sind. Da jedoch der Fondsvertrag grundsätzlich auch die Möglichkeit einer Sacheinlage vorsieht, erfolgt an dieser Stelle eine Ergänzung betreffend die Leistung einer Sacheinlage.

§ 5 Ziff. 4 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

*"Die Anleger sind nur zur Einzahlung bzw. zur Leistung der Sacheinlage im Umfang der von ihnen gezeichneten Anteile in das entsprechende Teilvermögen verpflichtet. Ihre persönliche Haftung für Verbindlichkeiten des Umbrella-Fonds bzw. Teilvermögens ist ausgeschlossen."*

### 3. Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen

Bei der beispielhaften Aufzählung der dem Fondsvermögen belasteten Kosten für den An- und Verkauf der Anlagen, werden neu auch die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen aufgeführt (vgl. die Ergänzung in § 20 Ziff. 2 Bst. a des Fondsvertrages).

### 4. Angepasster Beschrieb des Anlegerkreises bei verschiedenen Anteilsklassen

Bei den im Folgenden aufgeführten Anteilsklassen wird der Anlegerkreisbeschrieb geändert (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages). Der angepasste Anlegerkreisbeschrieb der massgeblichen Anteilsklassen wird nachfolgend aufgeführt.

#### 4.1 Anteilsklassen C

Anteile der Anteilsklassen CT, CT CHF, CT EUR, CT GBP, CT USD, CTH CHF, CTH EUR, CTH GBP, CTH USD, CA, CA CHF, CA EUR, CA GBP, CA USD, CAH CHF, CAH EUR, CAH GBP, CAH USD werden allen Anlegern angeboten, welche einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Anlageberatungsvertrag, welcher die Zulassung zu den oben genannten Anteilsklassen umfasst, mit einem Kooperationspartner abgeschlossen haben. Die Anteile der oben genannten Anteilsklassen können nur von Kooperationspartnern angeboten werden, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

#### 4.2 Anteilsklassen D

Anteile der Anteilsklassen DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH CHF, DTH EUR, DTH GBP, DTH USD, DA, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD, DAH CHF, DAH EUR, DAH GBP, DAH USD stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) sowie Anlegern offen, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>ter</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklassen DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH CHF, DTH EUR, DTH GBP, DTH USD, DA, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD, DAH CHF, DAH EUR, DAH GBP, DAH USD stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilsklassen DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH CHF, DTH EUR, DTH GBP, DTH USD, DA, DA CHF, DA EUR, DA GBP, DA USD, DAH CHF, DAH EUR, DAH GBP, DAH USD ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>ter</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Die Anteile der oben genannten Anteilsklassen können grundsätzlich von sämtlichen Vertreibern angeboten werden.

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

#### 4.3 Anteilklassen G

Anteile der Anteilklassen GT, GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GTH CHF, GTH EUR, GTH GBP, GTH USD, GA, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH CHF, GAH EUR, GAH GBP, GAH USD stehen nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) offen, sofern diese einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren und auf Dauer angelegten Investitionsvertrag mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit einem Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrag i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>er</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilklassen GT, GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GTH CHF, GTH EUR, GTH GBP, GTH USD, GA, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH CHF, GAH EUR, GAH GBP, GAH USD stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen, stehen die Anteile der Anteilklassen GT, GT CHF, GT EUR, GT GBP, GT USD, GTH CHF, GTH EUR, GTH GBP, GTH USD, GA, GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH CHF, GAH EUR, GAH GBP, GAH USD ohne Abschluss eines schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Vermögensverwaltungsvertrages i.S.v. Art. 10 Abs. 3<sup>er</sup> KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG nicht zur Verfügung. Weitere Voraussetzung ist, dass der Finanzintermediär gemäss Art. 4 Abs. 3 lit. a FIDLEG eine Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe abgeschlossen hat.

#### 4.4 Anteilklassen M

Anteile der Anteilklassen MT, MT CHF, MT EUR, MT GBP, MT USD, MTH CHF, MTH EUR, MTH GBP, MTH USD, MA, MA CHF, MA EUR, MA GBP, MA USD, MAH CHF, MAH EUR, MAH GBP, MAH USD werden nur Anlegern angeboten, die einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren individuellen Anlageberatungsvertrag mit der Zürcher Kantonalbank abgeschlossen haben, welcher die Zulassung zu den oben genannten Anteilklassen umfasst. Die oben genannten Anteilklassen stehen den Anlegern der Zürcher Kantonalbank nur offen, sofern die Zürcher Kantonalbank mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe eine entsprechende Kooperationsvereinbarung abgeschlossen hat.

#### 4.5 Anteilklassen N

Anteile der Anteilklassen NT, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NTH CHF, NTH EUR, NTH GBP, NTH USD, NA, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH CHF, NAH EUR, NAH GBP, NAH USD werden nur professionellen Anlegern i.S.v. Art. 4 Abs. 3 lit. a – i FIDLEG (einschliesslich schweizerischen und ausländischen kollektiven Kapitalanlagen und deren Verwaltungsgesellschaften) angeboten, die einen schriftlichen oder anderweitig durch Text nachweisbaren Dienstleistungsvertrag (Vermögensverwaltungsvertrag, Beratungsvertrag, Investitionsvertrag oder ein anderer Dienstleistungsvertrag) mit einem entsprechenden Kooperationspartner der Swisscanto Fondsleitung AG oder einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe abgeschlossen haben, sowie Anlegern, die mit der Zürcher Kantonalbank einen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag abgeschlossen haben.

Anteile der Anteilklassen NT, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NTH CHF, NTH EUR, NTH GBP, NTH USD, NA, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH CHF, NAH EUR, NAH GBP, NAH USD stehen den vorerwähnten Anlegern auch im Falle eines Opting-in zum Privatkunden gemäss Art. 5 Abs. 5 FIDLEG zur Verfügung. Vermögenden Privatkunden und für diese errichtete private Anlagestrukturen ohne professionelle Tresorerie, welche durch ein Opting-out gemäss Art. 5 Abs. 1 FIDLEG als professionelle Kunden gelten wollen und keinen individuellen Vermögensverwaltungsvertrag mit der Zürcher Kantonalbank abgeschlossen haben, stehen Anteile der Anteilklassen NT, NT CHF, NT EUR, NT GBP, NT USD, NTH CHF, NTH EUR, NTH GBP, NTH USD, NA, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH CHF, NAH EUR, NAH GBP, NAH USD nicht zu Verfügung. Banken können die Anteile nur anbieten, sofern eine entsprechende Kooperationsvereinbarung mit der Swisscanto Fondsleitung AG oder mit einer anderen Gesellschaft der Swisscanto Gruppe besteht.

### 5. Änderung der Anlagepolitik von sechs Teilvermögen in Bezug auf die Nachhaltigkeitspolitik

Die in den nachfolgend aufgeführten Fondsvertragsbestimmungen enthaltenen Angaben zur Nachhaltigkeitspolitik des jeweiligen Teilvermögens werden überarbeitet (Umformulierungen, Präzisierungen und Ergänzung von Angaben zu den Zielen der Nachhaltigkeitspolitik):

- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages)
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages)

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible** beinhaltet Folgendes:

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 4 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Equity Fund World (ex CH) Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 12 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible** beinhaltet Folgendes:

Für dieses Teilvermögen schränkt der Vermögensverwalter das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. c und d von § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis d von § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 24 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 25 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible** beinhaltet Folgendes:

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität** der Anlagen im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis c von § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. d und f von § 8 Ziff. 17 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e- Intensität** der Anlagen im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS), EDGAR - Emissions Database for Global Atmospheric Research) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. a bis d und h von § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 22 des

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorennummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorennummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorennummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorennummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswährung:	CHF

Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. e und g von § 8 Ziff. 22 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

Die Nachhaltigkeitspolitik des Teilvermögens **Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible** beinhaltet Folgendes:

Der Vermögensverwalter schränkt das Anlageuniversum basierend auf Kriterien für eine nachhaltige Wirtschaftsweise mittels Anwendung von **Ausschlüssen** und mittels eines **ESG-Laggards-Out-Verfahrens** ein und richtet die Portfoliokonstruktion auf eine Reduktion der **CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** aus.

Die Reduktion des Anlageuniversums durch den Vermögensverwalter erfolgt durch **Ausschlüsse** und durch die Identifikation von Unternehmungen, welche im Vergleich zu Unternehmungen derselben Vergleichsgruppe (d.h. Unternehmungen zum Beispiel aus derselben Branche, Region und von vergleichbarer Grösse) unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien (Environment, Social, Governance; zum Beispiel Betrieb eines Umweltmanagement-Systems, Messung und Offenlegung des ökologischen Fussabdruckes, Arbeitsbedingungen, Diversität, Unabhängigkeit sowie Kompensation des Verwaltungsrates) schlecht abschneiden (**ESG-Laggards-Out-Verfahren**).

Zudem richtet der Vermögensverwalter die Portfoliokonstruktion auf eine **Reduktion der CO<sub>2</sub>e-Intensität der Anlagen** im Vergleich zum Referenzindex aus.

Der Vermögensverwalter stützt sich bei der Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik auf Daten von Drittanbietern (je nach Nachhaltigkeitsaspekt zum Beispiel MSCI ESG Research Inc., Institutional Shareholder Services Europe SA (ISS)) sowie auf eigene Analysen (zum Beispiel Plausibilisierung der Daten und Würdigung von Spezialfällen wie beispielsweise die Korrektur von statistischen Ausreissern bei den CO<sub>2</sub>e-Intensitäten).

Der Vermögensverwalter regelt in seinen internen Vorgaben, dass die Nachhaltigkeitspolitik mindestens bei den Anlagen gemäss lit. c von § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages angewendet wird. Bei indirekten Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages kann der Vermögensverwalter die Nachhaltigkeitspolitik aus Praktikabilitätsgründen nicht immer anwenden. Die Möglichkeit entsprechende indirekte Anlagen tätigen zu können ist jedoch insbesondere für die Bewirtschaftung der aggregierten Marktrisiken und für die effiziente Portfolioverwaltung erforderlich. Der Vermögensverwalter behält sich daher vor, die Nachhaltigkeitspolitik bei den indirekten Anlagen gemäss lit. a und b von § 8 Ziff. 30 des Fondsvertrages im Umfang von insgesamt höchstens 33% des Fondsvermögens nicht anzuwenden.

Ziele der Nachhaltigkeitspolitik des Vermögensverwalters sind die Beibehaltung des Rendite-/Risikoprofils und die Ausrichtung auf Werte (zum Beispiel Umweltschutz und keine Gefährdung von Gesellschaft und Gesundheit).

In Ziff. 1.2.1 des Prospektes finden sich neu detailliertere Angaben zur Umsetzung der Nachhaltigkeitspolitik der jeweiligen Teilvermögen (insbesondere zur angewandten Methodik, zu den verwendeten Daten und zu den massgeblichen Ausschlusskriterien).

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1, Ziff. 4 und Ziff. 5 der in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

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

Zürich, 01. November 2021

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Bericht der Prüfgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Anlagefonds

### Swisscanto (CH) Index Fund V

mit den Teilvermögen

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

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 28. Februar 2022 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 Prüfgesellschaft

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 28. Februar 2022 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Jahresbericht per 28.02.2022			
Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland			
Valorenummer Klasse ASTT CHF:	33 032 852	Klasse MT CHF:	34 283 163
Valorenummer Klasse DT CHF:	13 250 190	Klasse NT CHF:	13 250 189
Valorenummer Klasse FA CHF:	31 562 296		
Valorenummer Klasse GT CHF:	33 096 845	Rechnungswahrung:	CHF

**Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften**

Wir bestatigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhangigkeit gemass Revisionsaufsichtsgesetz erfullen und keine mit unserer Unabhangigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

Zurich, 29. Juni 2022