

## **Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Small & Mid Caps Switzerland (II)**

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

**Jahresbericht per 30. September 2021**

---

<b>Inhaltsverzeichnis</b>	<b>Seite</b>
Organisation und Verwaltung .....	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	9
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung .....	9
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte .....	9
Pauschale Verwaltungskommission .....	9
Benchmark.....	10
TER.....	10
Ausschüttung des Nettoertrags 2020 / 2021 .....	10
Thesaurierung des Nettoertrags 2020 / 2021.....	10
Erklärung der Fussnoten .....	10
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte .....	11
Bericht der Prüfgesellschaft.....	12

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

**Swisscanto Fondsleitung AG**

Zürich, 27.01.2022

## Organisation und Verwaltung

---

### Fondsleitung

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

### Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident  
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,  
Services & 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) EQUITY FUND RESPONSIBLE SMALL & MID CAPS SWITZERLAND (II)

Übersicht	von bis	01.10.2020 30.09.2021	01.10.2019 30.09.2020	01.10.2018 30.09.2019	01.10.2017 30.09.2018
<b>Konsolidiert</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		236'408'365.38	188'797'627.08	177'621'269.10	195'184'615.47
<b>Klasse AA CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		38'170'681.34	34'672'153.14	38'030'227.01	64'107'278.60
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'723.367	19'056.925	22'552.514	36'952.235
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		2'282.48	1'819.40	1'686.30	1'734.87
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		2'283.62	1'819.40	1'685.45	1'734.87
Ausschüttung je Anteil		-	3.60	2.60	-
Total Expense Ratio (TER)		1.60 %	1.60 %	1.60 %	1.60 %
<b>Klasse CT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		50'380'663.09	39'150'473.17	38'519'613.75	33'305'703.71
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		351'254.069	344'838.529	368'547.142	311'473.241
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		143.43	113.53	104.52	106.93
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		143.50	113.53	104.47	106.93
Thesaurierung je Anteil		0.66	0.89	0.77	0.56
Total Expense Ratio (TER)		0.83 %	0.83 %	0.83 %	0.83 %
<b>Klasse DT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'185'066.28	716'756.75	402'519.48	94'264.20
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'393.431	6'418.431	3'918.431	897.498
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		141.19	111.67	102.72	105.03
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		141.26	111.67	102.67	105.03
Thesaurierung je Anteil		0.80	0.99	0.86	0.68
Total Expense Ratio (TER)		0.72 %	0.72 %	0.72 %	0.72 %
<b>Klasse NT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		146'671'954.67	114'258'244.02	100'668'908.86	97'677'368.96
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'016'826.669	1'006'630.295	969'056.376	923'893.897
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		144.24	113.51	103.88	105.72
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		144.32	113.51	103.83	105.72
Thesaurierung je Anteil		1.78	1.77	1.57	1.35
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance	YTD / 30.09.2021	2020	2019	2018
Klasse AA CHF	15.36 %	10.77 %	27.99 %	-16.45 %
Klasse CT CHF	16.02 %	11.63 %	28.98 %	-15.80 %
Klasse DT CHF	16.07 %	11.75 %	29.13 %	-15.64 %
Klasse NT CHF	16.69 %	12.56 %	30.06 %	-15.02 %
Benchmark	17.52 %	8.07 %	30.42 %	-17.23 %
Tracking Error *	-	3.78 %	2.62 %	1.59 %

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)

<b>Vermögensrechnung (Verkehrswerte)</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Bankguthaben auf Sicht	3'987'138.17	4'715'921.50
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	231'433'586.52	183'092'836.07
Sonstige Vermögenswerte	1'076'668.40	1'060'587.56
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>236'497'393.09</b>	<b>188'869'345.13</b>
Andere Verbindlichkeiten	-89'027.71	-71'718.05
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>236'408'365.38</b>	<b>188'797'627.08</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse AA CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			19'056.925	22'552.514
Ausgegebene Anteile			549.776	1'002.624
Zurückgenommene Anteile			-2'883.334	-4'498.213
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>16'723.367</b>	<b>19'056.925</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse CT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			344'838.529	368'547.142
Ausgegebene Anteile			35'593.504	49'210.151
Zurückgenommene Anteile			-29'177.964	-72'918.764
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>351'254.069</b>	<b>344'838.529</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse DT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			6'418.431	3'918.431
Ausgegebene Anteile			3'550.000	5'381.952
Zurückgenommene Anteile			-1'575.000	-2'881.952
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>8'393.431</b>	<b>6'418.431</b>

<b>Entwicklung der Anzahl Anteile</b>	<b>Klasse NT CHF</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			1'006'630.295	969'056.376
Ausgegebene Anteile			140'795.928	113'884.919
Zurückgenommene Anteile			-130'599.554	-76'311.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>1'016'826.669</b>	<b>1'006'630.295</b>

<b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			188'797'627.08	177'621'269.10
Ausbezahlte Ausschüttung			-64'695.95	-54'976.40
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-710'465.72	-642'742.79
Saldo aus dem Anteilverkehr			-2'576'369.64	-4'525'139.33
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			50'962'269.61	16'399'216.50
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>236'408'365.38</b>	<b>188'797'627.08</b>

<b>Erfolgsrechnung</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.10.2020</b>	<b>01.10.2019</b>
		<b>bis</b>	<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
<b>Ertrag</b>				
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-104'150.95	-54'200.60
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte			3'076'195.33	3'033'639.75
Erträge der Gratisaktien			0.00	10.97
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			17'251.37	64'245.58
<b>Total Ertrag</b>			<b>2'989'295.75</b>	<b>3'043'695.70</b>
<b>Aufwand</b>				
Passivzinsen			0.00	-127.40
Reglementarische Vergütungen			-996'724.90	-878'564.19
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)			55'237.77	45'188.90
Sonstige Aufwendungen			0.00	-50.95
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-32'423.82	-46'694.72
<b>Total Aufwand</b>			<b>-973'910.95</b>	<b>-880'248.36</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			<b>2'015'384.80</b>	<b>2'163'447.34</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			39'125'998.33	11'984'200.98
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip			798'224.90	990'812.99
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)			42'447.76	56'587.41
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)			-55'237.77	-45'188.90
<b>Realisierter Erfolg</b>			<b>41'926'818.02</b>	<b>15'149'859.82</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			9'035'451.59	1'249'356.68
<b>Gesamterfolg</b>			<b>50'962'269.61</b>	<b>16'399'216.50</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>				
	<b>Klasse AA CHF</b>		<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Nettoertrag			-43'788.03	65'843.34
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten			43'788.03	0.00
Vortrag des Vorjahres			1'141.37	3'902.96
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>			<b>1'141.37</b>	<b>69'746.30</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg			0.00	68'604.93
Vortrag auf neue Rechnung			1'141.37	1'141.37
<b>Total</b>			<b>1'141.37</b>	<b>69'746.30</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>				
	<b>Klasse CT CHF</b>		<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Nettoertrag			235'297.29	308'730.91
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>			<b>235'297.29</b>	<b>308'730.91</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			82'354.05	108'055.82
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage			152'943.24	200'675.09
<b>Total</b>			<b>235'297.29</b>	<b>308'730.91</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>				
	<b>Klasse DT CHF</b>		<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Nettoertrag			6'750.41	6'387.08
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>			<b>6'750.41</b>	<b>6'387.08</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			2'362.64	2'235.48
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage			4'387.77	4'151.60
<b>Total</b>			<b>6'750.41</b>	<b>6'387.08</b>
<b>Verwendung des Erfolges</b>				
	<b>Klasse NT CHF</b>		<b>30.09.2021</b>	<b>30.09.2020</b>
Nettoertrag			1'817'125.13	1'782'486.01
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>			<b>1'817'125.13</b>	<b>1'782'486.01</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			635'993.80	623'870.10
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage			1'181'131.33	1'158'615.91
<b>Total</b>			<b>1'817'125.13</b>	<b>1'782'486.01</b>

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2020	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 30.09.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>								<b>231'433'586.52</b>	<b>97.86</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>								<b>231'433'586.52</b>	<b>97.86</b>	
AT0000A18XM4	AMS AG	351'426	199'311	411'772	138'965	CHF	17.06	2'370'048.08	1.00	a)
AT0000KTM102	PIERER MOBILITY AG	17'189	3'117	20'306	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>AT</b>								<b>2'370'048.08</b>	<b>1.00</b>	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	0	478'333	205'190	273'143	CHF	10.24	2'796'984.32	1.18	a)
CH0001503199	BELIMO HOLDING AG-REG	292	100	392	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0001752309	FISCHER (GEORG)-REG	5'946	2'739	6'742	1'943	CHF	1'390.00	2'700'770.00	1.14	a)
CH0002088976	VALORA HOLDING AG-REG	0	6'849	3'983	2'866	CHF	183.00	524'478.00	0.22	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	0	39'309	0	39'309	CHF	38.98	1'532'264.82	0.65	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	3'597	7'451	1'180	9'868	CHF	446.00	4'401'128.00	1.86	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	1'927	783	517	2'193	CHF	1'846.00	4'048'278.00	1.71	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	45'994	55'474	89'671	11'797	CHF	91.40	1'078'245.80	0.46	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	1'997	3'317	1'925	3'389	CHF	2'120.00	7'184'680.00	3.04	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	65	17	7	75	CHF	109'900.00	8'242'500.00	3.49	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	644	536	300	880	CHF	10'420.00	9'169'600.00	3.88	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	0	2'460	0	2'460	CHF	246.20	605'652.00	0.26	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	1'299	1'372	1'596	1'075	CHF	1'096.00	1'178'200.00	0.50	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	3'595	361	2'295	1'661	CHF	310.50	515'740.50	0.22	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	0	27'703	0	27'703	CHF	43.38	1'201'756.14	0.51	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	2'086	1'589	833	2'842	CHF	416.00	1'182'272.00	0.50	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	0	3'267	0	3'267	CHF	531.50	1'736'410.50	0.73	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	133'231	120'177	110'727	142'681	CHF	47.02	6'708'860.62	2.84	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	87'993	0	87'993	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	31'698	96'085	60'714	67'069	CHF	48.20	3'232'725.80	1.37	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	0	12'419	0	12'419	CHF	245.50	3'048'864.50	1.29	a)
CH0012280076	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5'415	3'265	2'994	5'686	CHF	1'683.50	9'572'381.00	4.05	a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	35'481	7'858	33'472	9'867	CHF	78.75	777'026.25	0.33	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	24'007	49'572	32'716	40'863	CHF	142.30	5'814'804.90	2.46	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	52'034	39'269	70'631	20'672	CHF	127.10	2'627'411.20	1.11	a)
CH0012530207	BACHEM HOLDING AG-REG B	10'078	883	4'428	6'533	CHF	715.00	4'671'095.00	1.98	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	31'771	27'806	6'577	53'000	CHF	355.20	18'825'600.00	7.96	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	3'517	955	1'076	3'396	CHF	963.00	3'270'348.00	1.38	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	4'325	1'795	3'216	2'904	CHF	834.00	2'421'936.00	1.02	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	23'931	14'412	2'102	36'241	CHF	88.90	3'221'824.90	1.36	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	919	5'768	575	6'112	CHF	884.00	5'403'008.00	2.28	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	16'954	53'382	58'758	11'578	CHF	112.60	1'303'682.80	0.55	a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	163'107	31'504	194'611	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0023405456	DUFREY AG-REG	0	37'106	21'247	15'859	CHF	52.82	837'672.38	0.35	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	16	86'077	27'322	58'771	CHF	20.70	1'216'559.70	0.51	a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	0	5'433	1'419	4'014	CHF	270.00	1'083'780.00	0.46	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	26'969	14'014	19'021	21'962	CHF	251.20	5'516'854.40	2.33	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	9'850	4'513	3'761	10'602	CHF	241.40	2'559'322.80	1.08	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	10'391	10'815	625	20'581	CHF	319.40	6'573'571.40	2.78	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	0	4'558	1'106	3'452	CHF	377.00	1'301'404.00	0.55	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	176'681	73'350	250'031	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	4'742	10'549	4'742	10'549	CHF	72.30	762'692.70	0.32	a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	5'221	8'272	3'273	10'220	CHF	332.00	3'393'040.00	1.43	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	0	19'409	5'132	14'277	CHF	61.85	883'032.45	0.37	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	31'964	36'301	40'100	28'165	CHF	89.20	2'512'318.00	1.06	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	0	6'763	6'763	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	0	107	107	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0042615283	ZUR ROSE GROUP AG	0	4'377	3'108	1'269	CHF	374.00	474'606.00	0.20	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	1'642'100	1'735'319	2'422'561	954'858	CHF	1.40	1'336'801.20	0.57	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 2)	Kauf Zugang 3)	Verkauf Abgang 30.09.2021	Anz / Nom in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>01.10.2020</b>										
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	114'003	251'510	167'579	197'934	CHF	62.32	12'335'246.88	5.22	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	0	104'732	104'732	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	18'873'716	7'400'331	20'973'304	5'300'743	CHF	0.42	2'241'154.14	0.95	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	10'695	105'621	33'524	82'792	CHF	18.24	1'510'126.08	0.64	a)
CH0111677362	ORIOR AG	19'692	6'590	16'714	9'568	CHF	91.20	872'601.60	0.37	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	17'888	3'808	1'103	20'593	CHF	61.20	1'260'291.60	0.53	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	24'140	760	2'811	22'089	CHF	45.10	996'213.90	0.42	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	28'669	5'190	1'560	32'299	CHF	73.25	2'365'901.75	1.00	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	0	668	668	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0130293662	BKW AG	42'140	17'464	59'604	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0190891181	LEONTEQ AG	92'240	41'293	58'439	75'094	CHF	57.10	4'287'867.40	1.81	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	58'903	11'512	32'264	38'151	CHF	62.90	2'399'697.90	1.01	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	3'525	17'845	7'501	13'869	CHF	127.20	1'764'136.80	0.75	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	1'438	580	1'157	861	CHF	1'264.00	1'088'304.00	0.46	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	18'730	27'423	7'952	38'201	CHF	18.22	696'022.22	0.29	a)
CH0267291224	SUNRISE COMMUNICATIONS GROUP	57'305	0	57'305	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	6'646	25'487	19'015	13'118	CHF	99.20	1'301'305.60	0.55	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	32'474	13'918	31'152	15'240	CHF	370.20	5'641'848.00	2.39	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	8'057	14'915	702	22'270	CHF	167.00	3'719'090.00	1.57	a)
CH0360674466	GALENICA AG	67'845	74'815	3'918	138'742	CHF	65.90	9'143'097.80	3.87	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	7'789	5'930	13'719	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0363463438	IDORSIA LTD	13'425	147'288	22'846	137'867	CHF	22.58	3'113'036.86	1.32	a)
CH0364749348	VIFOR PHARMA AG	41'770	49'579	39'535	51'814	CHF	121.50	6'295'401.00	2.66	a)
CH0371153492	LANDIS+GYR GROUP AG	0	27'203	27'203	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	6'272	0	6'272	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0435377954	SIG COMBIBLOC GROUP AG	403'864	211'672	372'847	242'689	CHF	24.92	6'047'809.88	2.56	a)
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	24'918	25'337	24'579	25'676	CHF	101.90	2'616'384.40	1.11	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	0	209'321	87'290	122'031	CHF	20.55	2'507'737.05	1.06	a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	3	0	3	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0528751586	VZ HOLDING AG	6'075	190	389	5'876	CHF	92.90	545'880.40	0.23	a)
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	5'062	41'208	23'985	22'285	CHF	57.90	1'290'301.50	0.55	a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	0	6'912	6'912	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	0	432	432	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0565630669	SUNRISE COMMUNICATIONS G-NEW	0	57'305	57'305	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	0	6'080	397	5'683	CHF	494.00	2'807'402.00	1.19	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	0	30'880	0	30'880	CHF	33.40	1'031'392.00	0.44	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	0	6'617	0	6'617	CHF	120.40	796'686.80	0.34	a)
CH1129677105	MEDMIX AG	0	28'165	0	28'165	CHF	44.00	1'239'260.00	0.52	a)
<b>CH</b>								<b>227'364'381.64</b>	<b>96.14</b>	
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	0	32'181	0	32'181	CHF	52.80	1'699'156.80	0.72	a)
<b>LI</b>								<b>1'699'156.80</b>	<b>0.72</b>	
<b>Bezugsrechte</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0572852298	IDORSIA LTD-RIGHTS	0	13'425	13'425	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

<b>Vermögensaufstellung</b>	<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
Bankguthaben auf Sicht	3'987'138.17	1.69
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	231'433'586.52	97.86
Sonstige Vermögenswerte	1'076'668.40	0.46
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>236'497'393.09</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-89'027.71	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>236'408'365.38</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>	<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	231'433'586.52	97.86
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00



## Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	0.00	0.00
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	0.00	0.00
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	0.00	0.00

\* In Prozent der Risikolimiten (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimiten zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100 %.

## Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes	
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung
01.10.2020 – 30.09.2021	n/a	0.00	n/a	0.00

## 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 Vereinbarung bezüglich sogenannten «soft commissions» abgeschlossen.

## 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.
AA CHF	01.10.2020 – 30.09.2021	1.60 %	1.25 %	0.35 %	2.20 %	4.00 %
CT CHF	01.10.2020 – 30.09.2021	0.83 %	0.48 %	0.35 %	1.45 %	4.00 %
DT CHF	01.10.2020 – 30.09.2021	0.72 %	0.54 %	0.18 %	1.30 %	4.00 %
NT CHF	01.10.2020 – 30.09.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	4.00 %

Gemäss Richtlinie für Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebühren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Teilvermögens bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Teilvermögens. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Teilvermögen belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

## Benchmark

SPI Extra® TR (Swiss Performance Index Extra Total Return)

## TER

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

## Ausschüttung des Nettoertrags 2020 / 2021

Ex Datum: 25.01.2022

Zahlbar: 28.01.2022

			Ausschüttung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	0.00	0.00	0.00

## Thesaurierung des Nettoertrags 2020 / 2021

Ex Datum: 25.01.2022

Zahlbar: 28.01.2022

			Thesaurierung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	0.66987	0.23445	0.43542
DT CHF	Nein	CHF	0.80424	0.28148	0.52276
NT CHF	Nein	CHF	1.787	0.625	1.162

## Erklärung der Fussnoten

- Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet
- Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen
- Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen
- Gemäss Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 23.02.2018 der Eidgenössischen Steuerverwaltung
- Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen
- Kursangabe der britischen Titel in Pence

## Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-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.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens der Teilvermögen führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 5.2.2) näher definierten Periode.

In ausserordentlichen Situationen kann die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
  - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

## Bericht der Prüfgesellschaft

---

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegende Jahresrechnung des Anlagefonds

### Swisscanto (CH) Investment Fund IV

mit dem Teilvermögen

- Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Small & Mid Caps Switzerland (II)

bestehend aus der Vermögensrechnung und der Erfolgsrechnung, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b - h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) für das am 30. September 2021 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

### Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnung 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 Jahresrechnung, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern ist. 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 Jahresrechnung 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 Jahresrechnung frei von wesentlichen falschen Angaben ist.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in der Jahresrechnung 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 der Jahresrechnung als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein.

Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnung von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungs-handlungen 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 Jahresrechnung. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

### Prüfungsurteil

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

### Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 27. Januar 2022