

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»**

Halbjahresbericht per 31. März 2022

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	8
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	8
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	8
Pauschale Verwaltungskommission	8
Benchmark.....	9
TER.....	9
Erklärung der Fussnoten	9
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	10

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 13.05.2022

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Prasident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Directbanking, Zurcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizeprasident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zurcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement
Anlage- & Vorsorgegeschaft, Zurcher Kantonalbank

Geschaftsfuhrung

Hans Frey
Geschaftsfuhrer

Andreas Hogg
stellvertretender Geschaftsfuhrer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Depotbank

Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Prufgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zurich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

Vertriebstrager Zurcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zurich

SWISSCANTO (CH) EQUITY FUND RESPONSIBLE SMALL & MID CAPS SWITZERLAND (II)

Übersicht	von bis	01.10.2021 31.03.2022	01.10.2020 30.09.2021	01.10.2019 30.09.2020	01.10.2018 30.09.2019
Konsolidiert		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		218'283'155.95	236'408'365.38	188'797'627.08	177'621'269.10
Klasse AA CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		34'617'350.03	38'170'681.34	34'672'153.14	38'030'227.01
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'068.151	16'723.367	19'056.925	22'552.514
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		2'154.4078	2'282.4800	1'819.4000	1'686.3000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		2'155.9159	2'283.6200	1'819.4000	1'685.4500
Ausschüttung je Anteil		-	-	3.60	2.60
Total Expense Ratio (TER)		1.60 %	1.60 %	1.60 %	1.60 %
Klasse CT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		46'366'399.72	50'380'663.09	39'150'473.17	38'519'613.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		341'760.598	351'254.069	344'838.529	368'547.142
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		135.6692	143.4300	113.5300	104.5200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		135.7642	143.5000	113.5300	104.4700
Thesaurierung je Anteil		-	0.66	0.89	0.77
Total Expense Ratio (TER)		0.83 %	0.83 %	0.83 %	0.83 %
Klasse DT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'675'030.01	1'185'066.28	716'756.75	402'519.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		20'026.873	8'393.431	6'418.431	3'918.431
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		133.5720	141.1900	111.6700	102.7200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		133.6655	141.2600	111.6700	102.6700
Thesaurierung je Anteil		-	0.80	0.99	0.86
Total Expense Ratio (TER)		0.72 %	0.72 %	0.72 %	0.72 %
Klasse NT CHF		CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		134'624'376.19	146'671'954.67	114'258'244.02	100'668'908.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		985'428.316	1'016'826.669	1'006'630.295	969'056.376
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		136.6151	144.2400	113.5100	103.8800
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		136.7107	144.3200	113.5100	103.8300
Thesaurierung je Anteil		-	1.78	1.77	1.57
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 / 31.03.2022	2021	2020	2019
Klasse AA CHF	-10.04 %	21.06 %	10.77 %	27.99 %
Klasse CT CHF	-9.87 %	21.99 %	11.63 %	28.98 %
Klasse DT CHF	-9.91 %	22.13 %	11.75 %	29.13 %
Klasse NT CHF	-9.75 %	23.01 %	12.56 %	30.06 %
Benchmark	-10.16 %	22.19 %	8.07 %	30.42 %
Tracking Error *	-	-	3.78 %	2.62 %

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)	31.03.2022	30.09.2021
Bankguthaben auf Sicht	12'429'127.42	3'987'138.17
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	205'739'904.96	231'433'586.52
Sonstige Vermögenswerte	194'011.85	1'076'668.40
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	218'363'044.23	236'497'393.09
Andere Verbindlichkeiten	-79'888.28	-89'027.71
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	218'283'155.95	236'408'365.38

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse AA CHF	von	01.10.2021	01.10.2020
		bis	31.03.2022	30.09.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			16'723.367	19'056.925
Ausgegebene Anteile			218.795	549.776
Zurückgenommene Anteile			-874.011	-2'883.334
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			16'068.151	16'723.367

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse CT CHF	von	01.10.2021	01.10.2020
		bis	31.03.2022	30.09.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			351'254.069	344'838.529
Ausgegebene Anteile			10'110.681	35'593.504
Zurückgenommene Anteile			-19'604.152	-29'177.964
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			341'760.598	351'254.069

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DT CHF	von	01.10.2021	01.10.2020
		bis	31.03.2022	30.09.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			8'393.431	6'418.431
Ausgegebene Anteile			12'130.940	3'550.000
Zurückgenommene Anteile			-497.498	-1'575.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			20'026.873	8'393.431

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT CHF	von	01.10.2021	01.10.2020
		bis	31.03.2022	30.09.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			1'016'826.669	1'006'630.295
Ausgegebene Anteile			17'868.391	140'795.928
Zurückgenommene Anteile			-49'266.744	-130'599.554
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			985'428.316	1'016'826.669

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	von	01.10.2021	01.10.2020
		bis	31.03.2022	30.09.2021
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			236'408'365.38	188'797'627.08
Ausbezahlte Ausschüttung			0.00	-64'695.95
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-700'352.78	-710'465.72
Saldo aus dem Anteilverkehr			-5'989'210.56	-2'576'369.64
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			-11'435'646.09	50'962'269.61
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			218'283'155.95	236'408'365.38

Erfolgsrechnung	(konsolidiert)	von	01.10.2021	01.10.2020
		bis	31.03.2022	30.09.2021
Ertrag				
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-30'219.95	-104'150.95
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte			459'210.63	3'076'195.33
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			-7'928.35	17'251.37
Total Ertrag			421'062.33	2'989'295.75
Aufwand				
Reglementarische Vergütungen			-505'640.10	-996'724.90
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)			18'462.11	55'237.77
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			13'537.52	-32'423.82
Total Aufwand			-473'640.47	-973'910.95
Nettoertrag / Verlust			-52'578.14	2'015'384.80
Realisierter Erfolg				
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			8'271'804.56	39'125'998.33
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip			42'991.40	798'224.90
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)			9'935.98	42'447.76
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)			-18'462.11	-55'237.77
Realisierter Erfolg			8'253'691.69	41'926'818.02
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			-19'689'337.78	9'035'451.59
Gesamterfolg			-11'435'646.09	50'962'269.61

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind								205'739'904.96	94.22	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								205'739'904.96	94.22	
AT0000A18XM4	AMS-OSRAM AG	138'965	228'838	291'116	76'687	CHF	14.27	1'093'940.06	0.50	a)
AT								1'093'940.06	0.50	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	273'143	0	249'472	23'671	CHF	7.40	175'165.40	0.08	a)
CH0001752309	FISCHER (GEORG)-REG	1'943	0	1'943	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002088976	VALORA HOLDING AG-REG	2'866	0	2'866	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002178181	STADLER RAIL AG	39'309	0	39'309	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	9'868	1'209	3'122	7'955	CHF	374.80	2'981'534.00	1.37	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	2'193	319	93	2'419	CHF	1'576.00	3'812'344.00	1.75	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	11'797	12'479	11'797	12'479	CHF	91.25	1'138'708.75	0.52	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	3'389	1'395	289	4'495	CHF	2'170.00	9'754'150.00	4.47	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	75	8	13	70	CHF	111'800.00	7'826'000.00	3.58	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	880	169	353	696	CHF	11'020.00	7'669'920.00	3.51	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	2'460	2'008	2'460	2'008	CHF	260.00	522'080.00	0.24	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	1'075	1'627	933	1'769	CHF	1'064.00	1'882'216.00	0.86	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	1'661	0	1'661	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	27'703	3'376	4'591	26'488	CHF	37.24	986'413.12	0.45	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	2'842	1'067	298	3'611	CHF	462.50	1'670'087.50	0.76	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	3'267	6'600	2'757	7'110	CHF	368.00	2'616'480.00	1.20	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	142'681	59'024	104'436	97'269	CHF	42.01	4'086'270.69	1.87	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	0	23'969	23'969	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	67'069	19'096	24'781	61'384	CHF	50.40	3'093'753.60	1.42	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	12'419	12'059	10'082	14'396	CHF	263.70	3'796'225.20	1.74	a)
CH0012280076	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5'686	3'495	3'081	6'100	CHF	1'486.50	9'067'650.00	4.15	a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	9'867	11'790	9'744	11'913	CHF	78.15	931'000.95	0.43	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	40'863	5'810	24'079	22'594	CHF	165.10	3'730'269.40	1.71	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	20'672	45'940	31'699	34'913	CHF	89.00	3'107'257.00	1.42	a)
CH0012530207	BACHEM HOLDING AG-REG B	6'533	2'008	5'061	3'480	CHF	511.00	1'778'280.00	0.81	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	53'000	4'948	12'766	45'182	CHF	387.60	17'512'543.20	8.02	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	3'396	0	1'329	2'067	CHF	1'011.00	2'089'737.00	0.96	a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	0	6'949	6'949	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	2'904	1'087	3'356	635	CHF	765.00	485'775.00	0.22	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	36'241	3'345	15'203	24'383	CHF	95.80	2'335'891.40	1.07	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	6'112	2'318	445	7'985	CHF	901.50	7'198'477.50	3.30	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	11'578	17'223	11'578	17'223	CHF	121.60	2'094'316.80	0.96	a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	0	11'021	2'765	8'256	CHF	163.00	1'345'728.00	0.62	a)
CH0023405456	DUFREY AG-REG	15'859	31'967	39'475	8'351	CHF	39.11	326'607.61	0.15	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	58'771	0	58'771	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	4'014	6'690	1'154	9'550	CHF	225.50	2'153'525.00	0.99	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	21'962	7'363	17'758	11'567	CHF	199.00	2'301'833.00	1.05	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	10'602	4'009	4'866	9'745	CHF	197.90	1'928'535.50	0.88	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	20'581	26'254	6'128	40'707	CHF	263.10	10'710'011.70	4.90	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	3'452	1'587	0	5'039	CHF	489.00	2'464'071.00	1.13	a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	10'549	0	10'549	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	10'220	4'682	1'726	13'176	CHF	306.00	4'031'856.00	1.85	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	14'277	1'192	5'998	9'471	CHF	89.85	850'969.35	0.39	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	28'165	20'090	25'508	22'747	CHF	76.90	1'749'244.30	0.80	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	0	21'214	0	21'214	CHF	64.70	1'372'545.80	0.63	a)
CH0042615283	ZUR ROSE GROUP AG	1'269	6'211	7'480	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0043238366	ARYZTA AG	954'858	796'546	540'260	1'211'144	CHF	0.95	1'150'586.80	0.53	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	197'934	58'249	134'193	121'990	CHF	53.88	6'572'821.20	3.01	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	5'300'743	7'224'405	4'645'749	7'879'399	CHF	0.39	3'063'510.33	1.40	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	82'792	5'285	0	88'077	CHF	18.12	1'595'955.24	0.73	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.03.2022	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0111677362	ORIOR AG	9'568	0	9'568	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	20'593	19'640	0	40'233	CHF	57.00	2'293'281.00	1.05	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	22'089	12'639	0	34'728	CHF	51.00	1'771'128.00	0.81	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	32'299	35'253	0	67'552	CHF	77.75	5'252'168.00	2.41	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	75'094	12'509	17'957	69'646	CHF	74.50	5'188'627.00	2.38	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	38'151	26'509	17'409	47'251	CHF	68.00	3'213'068.00	1.47	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	13'869	4'285	18'154	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0244017502	BYSTRONIC AG	861	104	900	65	CHF	955.00	62'075.00	0.03	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	38'201	71'807	25'132	84'876	CHF	18.62	1'580'391.12	0.72	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	13'118	15'282	380	28'020	CHF	80.20	2'247'204.00	1.03	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	15'240	16'737	14'163	17'814	CHF	354.40	6'313'281.60	2.89	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZÜRICH AG-REG	22'270	8'248	0	30'518	CHF	166.60	5'084'298.80	2.33	a)
CH0360674466	GALENICA AG	138'742	6'696	34'210	111'228	CHF	71.25	7'924'995.00	3.63	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	0	2'716	2'716	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0363463438	IDORSIA LTD	137'867	42'466	23'449	156'884	CHF	18.43	2'891'372.12	1.32	a)
CH0364749348	VIFOR PHARMA AG	51'814	21'445	73'259	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0371153492	LANDIS+GYR GROUP AG	0	5'087	5'087	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0435377954	SIG COMBIBLOC GROUP AG	242'689	221'393	94'088	369'994	CHF	23.40	8'657'859.60	3.96	a)
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	25'676	2'535	17'634	10'577	CHF	120.70	1'276'643.90	0.58	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	122'031	185'952	165'989	141'994	CHF	13.06	1'854'441.64	0.85	a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	5'876	0	5'876	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	22'285	0	22'285	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	0	5'571	0	5'571	CHF	80.20	446'794.20	0.20	a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	0	3'410	3'410	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	5'683	342	60	5'965	CHF	492.50	2'937'762.50	1.35	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	30'880	63'786	0	94'666	CHF	16.28	1'541'162.48	0.71	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	6'617	5'250	11'867	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1129677105	MEDMIX AG	28'165	0	28'165	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH								204'496'901.30	93.65	
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	32'181	1'594	31'094	2'681	CHF	55.60	149'063.60	0.07	a)
LI								149'063.60	0.07	
Vermögensaufstellung								Kurswert CHF	in % 7)	
Bankguthaben auf Sicht								12'429'127.42	5.69	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								205'739'904.96	94.22	
Sonstige Vermögenswerte								194'011.85	0.09	
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode								218'363'044.23	100.00	
Andere Verbindlichkeiten								-79'888.28		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode								218'283'155.95		
Bewertungskategorien								Kurswert CHF	in % 7)	
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);							205'739'904.96	94.22	
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 Risikolimit (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimit 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
01.10.2021 – 31.03.2022	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	01.10.2021 – 31.03.2022	1.60 %	1.25 %	0.35 %	2.20 %	4.00 %
CT CHF	01.10.2021 – 31.03.2022	0.83 %	0.48 %	0.35 %	1.45 %	4.00 %
DT CHF	01.10.2021 – 31.03.2022	0.72 %	0.54 %	0.18 %	1.30 %	4.00 %
NT CHF	01.10.2021 – 31.03.2022	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 AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt.

Erklahrung der Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet
- 2) Kaufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Kaufe / Gratistitel / Konversionen / Namensanderungen / Splits / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / ubertrage / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen
- 3) Verkaufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkaufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausubungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Ruckzahlungen / ubertrage / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen
- 4) Gemass Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 23.02.2018 der Eidgenossischen Steuerverwaltung
- 7) Allfallige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zuruckzufuhren
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence
- 23) Anpassung der Nachkommastellen von 2 auf 4 per 16.12.2021

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 zuflussenden 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.