Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

Jahresbericht per 31. Januar 2022

Inhaltsverzeichnis **Seite**

Organisation und Verwaltung 2

Vertriebsorganisation 2

Abschlusszahlen 3

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I 8

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung 8

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte 8

Pauschale Verwaltungskommission 9

Benchmark 9

TER 9

Ausschüttung des Nettoertrags 2021 / 2022 9

Thesaurierung des Nettoertrags 2021 / 2022 10

Erklärung der Fussnoten 10

Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte 11

Pflichtpublikationen 12

Bericht der Prüfgesellschaft 17

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 25.05.2022

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung	
Firma:	Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz:	Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Verwaltungsrat	Daniel Previdoli, Präsident Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products, Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank Christoph Schenk, Vizepräsident Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions, Zürcher Kantonalbank Regina Kleeb, Mitglied Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank
Geschäftsleitung	Hans Frey Geschäftsführer Andreas Hogg stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services Silvia Karrer Leiterin Administration & Operations
Delegation der Anlageentscheide	Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration	
Firma:	Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz:	Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Depotbank	Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Prüfgesellschaft	Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle	Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Vertriebsträger	Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND LARGE CAPS SWITZERLAND

Übersicht	von	01.02.2021	01.02.2020	01.02.2019	01.02.2018
	bis	31.01.2022	31.01.2021	31.01.2020	31.01.2019
Konsolidiert		**CHF**			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'509'701'239.68	1'400'623'073.63	1'164'488'371.50	1'247'689'717.71
Klasse FA CHF		**CHF**			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		19'901'037.86	15'787'932.21	8'428'330.88	4'942'498.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		126'083.103	115'844.241	60'940.608	42'913.656
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		157.8406	136.2859	138.3040	115.1731
Ausschüttung je Anteil		3.60	3.60	3.20	2.80
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.19 %	0.22 %
Klasse GT CHF		**CHF**			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		5'130'979.63	5'678'219.51	49'140'415.26	177'712'397.89
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		29'580.000	38'535.000	334'007.306	1'472'273.589
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		173.4611	147.3523	147.1238	120.7061
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		166.1970	136.3389	137.6521	106.0330
Thesaurierung je Anteil		3.97	3.83	3.40	3.13
Total Expense Ratio (TER)		0.11 %	0.12 %	0.14 %	0.14 %
Klasse MT CHF		**CHF**			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		70'643'203.36	59'710'273.98	59'573'470.12	48'832'325.70
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		405'432.976	403'712.976	403'712.976	403'712.976
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		174.2414	147.9028	147.5639	120.9580
Thesaurierung je Anteil		4.17	4.01	3.59	3.30
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT CHF		**CHF**			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'414'026'018.83	1'319'446'647.93	1'047'346'155.24	1'016'202'495.91
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		8'581'844.337	9'433'873.005	7'505'586.140	8'884'231.932
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		164.7695	139.8627	139.5422	114.3827
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		157.8694	129.4091	130.5587	100.4783
Thesaurierung je Anteil		3.94	3.80	3.40	3.12
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 / 31.01.2022	2021	2020	2019
Klasse FA CHF	-5.20 %	23.49 %	2.67 %	30.33 %
Klasse GT CHF	-5.20 %	23.53 %	2.70 %	30.42 %
Klasse MT CHF	-5.19 %	23.67 %	2.82 %	30.60 %
Klasse NT CHF	-5.19 %	23.67 %	2.82 %	30.60 %
Benchmark	-5.19 %	23.70 %	2.79 %	30.62 %
Tracking Error *	-	0.03 %	0.04 %	0.94 %

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)

Erklärung der Fussnoten auf Seite 10

Valorennummer Klasse FA CHF:	21 580 468
Valorennummer Klasse GT CHF:	33 099 938
Valorennummer Klasse MT CHF:	34 282 986
Valorennummer Klasse NT CHF:	21 580 471
Rechnungswährung:	CHF

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	**31.01.2022**	**31.01.2021**
Bankguthaben auf Sicht	23'427'400.62	5'252'026.15
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'482'351'779.78	1'392'029'146.52
Sonstige Vermögenswerte	3'924'915.00	3'347'751.52
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	**1'509'704'095.40**	**1'400'628'924.19**
Andere Verbindlichkeiten	-2'855.72	-5'850.56
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	**1'509'701'239.68**	**1'400'623'073.63**

Entwicklung der Anzahl Anteile	**Klasse FA CHF**	**von**	**01.02.2021**	**01.02.2020**
		bis	**31.01.2022**	**31.01.2021**
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			115'844.241	60'940.608
Ausgegebene Anteile			24'445.752	84'679.890
Zurückgenommene Anteile			-14'206.890	-29'776.257
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			**126'083.103**	**115'844.241**

Entwicklung der Anzahl Anteile	**Klasse GT CHF**	**von**	**01.02.2021**	**01.02.2020**
		bis	**31.01.2022**	**31.01.2021**
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			38'535.000	334'007.306
Ausgegebene Anteile			-	104'872.000
Zurückgenommene Anteile			-8'955.000	-400'344.306
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			**29'580.000**	**38'535.000**

Entwicklung der Anzahl Anteile	**Klasse MT CHF**	**von**	**01.02.2021**	**01.02.2020**
		bis	**31.01.2022**	**31.01.2021**
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			403'712.976	403'712.976
Ausgegebene Anteile			1'720.000	12.078
Zurückgenommene Anteile			-	-12.078
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			**405'432.976**	**403'712.976**

Entwicklung der Anzahl Anteile	**Klasse NT CHF**	**von**	**01.02.2021**	**01.02.2020**
		bis	**31.01.2022**	**31.01.2021**
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			9'433'873.005	7'505'586.140
Ausgegebene Anteile			898'295.746	2'012'269.488
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)			-	974'996.495
Zurückgenommene Anteile			-1'750'324.414	-1'058'979.118
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			**8'581'844.337**	**9'433'873.005**

Veränderung des Nettofondsvermögens	**(konsolidiert)**	**von**	**01.02.2021**	**01.02.2020**
		bis	**31.01.2022**	**31.01.2021**
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			1'400'623'073.63	1'164'488'371.50
Ausbezahlte Ausschüttung			-425'265.36	-215'250.91
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-13'476'218.57	-10'333'194.94
Saldo aus dem Anteilverkehr			-139'157'013.43	218'780'530.79
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			262'136'663.41	27'902'617.19
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			**1'509'701'239.68**	**1'400'623'073.63**

Erklärung der Fussnoten auf Seite 10

Valorennummer Klasse FA CHF:	21 580 468
Valorennummer Klasse GT CHF:	33 099 938
Valorennummer Klasse MT CHF:	34 282 986
Valorennummer Klasse NT CHF:	21 580 471
Rechnungswährung:	CHF

Erfolgsrechnung

(konsolidiert)	von bis	01.02.2021 31.01.2022	01.02.2020 31.01.2021
Ertrag			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-38'532.65	-46'734.60
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		40'142'614.19	33'136'432.93
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		486.50	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'800'265.48	9'472'040.03
Total Ertrag		**42'904'833.52**	**42'561'738.36**
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-101.70
Reglementarische Vergütungen		-31'770.02	-60'693.35
Sonstige Aufwendungen		0.00	-40.70
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-6'715'851.52	-4'450'457.19
Total Aufwand		**-6'747'621.54**	**-4'511'292.94**
Nettoertrag / Verlust		**36'157'211.98**	**38'050'445.42**
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		65'317'465.38	22'211'721.66
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		2'250'113.01	2'995'460.13
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		40'600.36	43'396.73
Realisierter Erfolg		**103'765'390.73**	**63'301'023.94**
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		158'371'272.68	-35'398'406.75
Gesamterfolg		**262'136'663.41**	**27'902'617.19**

Verwendung des Erfolges	Klasse FA CHF	31.01.2022	31.01.2021
Nettoertrag		458'663.72	421'303.44
Vortrag des Vorjahres		11'685.51	7'421.34
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		**470'349.23**	**428'724.78**
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		453'899.17	417'039.27
Vortrag auf neue Rechnung		16'450.06	11'685.51
Total		**470'349.23**	**428'724.78**

Verwendung des Erfolges	Klasse GT CHF	31.01.2022	31.01.2021
Nettoertrag		117'502.00	147'830.87
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		**117'502.00**	**147'830.87**
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		41'125.70	51'740.80
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		76'376.30	96'090.07
Total		**117'502.00**	**147'830.87**

Verwendung des Erfolges	Klasse MT CHF	31.01.2022	31.01.2021
Nettoertrag		1'693'009.51	1'622'744.55
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		**1'693'009.51**	**1'622'744.55**
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		592'553.33	567'960.59
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		1'100'456.18	1'054'783.96
Total		**1'693'009.51**	**1'622'744.55**

Verwendung des Erfolges	Klasse NT CHF	31.01.2022	31.01.2021
Nettoertrag		33'888'036.75	35'858'566.56
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		**33'888'036.75**	**35'858'566.56**
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		11'860'812.86	12'550'498.30
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		22'027'223.89	23'308'068.26
Total		**33'888'036.75**	**35'858'566.56**

Erklärung der Fussnoten auf Seite 10

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.01.2022	Währung	Kurs 8)		Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind									**1'482'351'779.78**	**98.19**	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte									**1'482'351'779.78**	**98.19**	
CH0002497458	SGS SA-REG	7'129	618	1'218	6'529	CHF	2'625.00		17'138'625.00	1.14	a)
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	29'520	2'951	5'109	27'362	CHF	528.20		14'452'608.40	0.96	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	9'241	874	1'550	8'565	CHF	3'818.00		32'701'170.00	2.17	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	174'807	16'315	29'098	162'024	CHF	440.70		71'403'976.80	4.73	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	2'866'262	251'970	496'716	2'621'516	CHF	80.13		210'062'077.08	13.91	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	816'246	76'601	136'290	756'557	CHF	356.90		270'015'193.30	17.89	a)
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2'541'241	910'412	740'765	2'710'888	CHF	8.76		23'747'378.88	1.57	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	601'242	113'726	107'417	607'551	CHF	49.75		30'225'662.25	2.00	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	2'122'242	177'235	568'974	1'730'503	CHF	31.71		54'874'250.13	3.63	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	33'618	1'470	35'088	0	CHF	0.00		0.00	0.00	
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	86'519	8'126	14'453	80'192	CHF	633.40		50'793'612.80	3.36	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	37'195	3'403	6'646	33'952	CHF	592.00		20'099'584.00	1.33	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	26'358	2'492	4'419	24'431	CHF	1'277.00		31'198'387.00	2.07	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	0	196'005	9'594	186'411	CHF	76.76		14'308'908.36	0.95	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	43'035	3'691	8'095	38'631	CHF	625.20		24'152'101.20	1.60	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	3'347'182	293'009	608'847	3'031'344	CHF	119.08		360'972'443.52	23.91	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	335'748	31'072	55'658	311'162	CHF	100.30		31'209'548.60	2.07	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	606'466	56'959	101'307	562'118	CHF	132.95		74'733'588.10	4.95	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	4'163'377	368'607	855'999	3'675'985	CHF	17.10		62'859'343.50	4.16	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	164'723	15'999	27'237	153'485	CHF	321.10		49'284'033.50	3.26	a)
CH0432492467	ALCON INC	580'558	54'721	97'175	538'104	CHF	70.84		38'119'287.36	2.52	a)
CH									**1'482'351'779.78**	**98.19**	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte									**0.00**	**0.00**	
CH1110994071	3.0000 % CS 3 11/12/21 B	0	973	973	0	CHF	0.00	%	0.00	0.00	
GG									**0.00**	**0.00**	
Bezugsrechte									**0.00**	**0.00**	
CH1111011453	CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	0	2'640'844	2'640'844	0	CHF	0.00		0.00	0.00	
Diverse									**0.00**	**0.00**	
Derivative Finanzinstrumente									**0.00**	**0.00**	
Futures									**0.00**	**0.00**	
03/21	SWISS MKT IX FUTR MAR21	68	93	161	0	CHF	0.00		0.00	0.00	
06/21	SWISS MKT IX FUTR JUN21	0	258	258	0	CHF	0.00		0.00	0.00	
09/21	SWISS MKT IX FUTR SEP21	0	180	180	0	CHF	0.00		0.00	0.00	
12/21	SWISS MKT IX FUTR DEC21	0	238	238	0	CHF	0.00		0.00	0.00	
03/22	SWISS MKT IX FUTR MAR22	0	121	63	58	CHF	0.00		0.00	0.00	a)

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	23'427'400.62	1.55
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'482'351'779.78	98.19
Sonstige Vermögenswerte	3'924'915.00	0.26
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	**1'509'704'095.40**	**100.00**
Andere Verbindlichkeiten	-2'855.72	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	**1'509'701'239.68**	

Bewertungskategorien		**Kurswert CHF**	**in % 7)**
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'482'351'779.78	98.19
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Umrechnungskurse

EUR	1 =	CHF	1.04370782
USD	1 =	CHF	0.93105000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	7'091'486.00	0.47
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	0.00	0.00

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

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Ausgabespesen in % des Nettoinventar-wertes	Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Rücknahme-spesen in % des Nettoinventar-wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.02.2021 – 31.01.2022	0.00 - 0.01	0.00	0.007	0.00 - 0.01	0.00	0.004

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.
FA CHF	01.02.2021 – 31.01.2022	0.14 %	0.09 %	0.05 %	0.50 %
GT CHF	01.02.2021 – 31.08.2021	0.12 %	0.07 %	0.05 %	0.35 %
GT CHF	01.09.2021 – 31.01.2022	0.10 %	0.05 %	0.05 %	0.35 %
MT CHF	01.02.2021 – 31.01.2022	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
NT CHF	01.02.2021 – 31.01.2022	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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 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

Swiss Performance Index® 20 TR (SPI® 20 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: 17.05.2022

Zahlbar: 20.05.2022

			Ausschüttung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	3.60	1.26	2.34

Thesaurierung des Nettoertrags 2021 / 2022

Ex Datum: 17.05.2022

Zahlbar: 20.05.2022

			Thesaurierung an die Anteilscheininhaber		
Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35% Eidg. Verrechnungsteuer	Netto je Anteil
GT CHF	Nein	CHF	3.972	1.390	2.582
MT CHF	Nein	CHF	4.175	1.461	2.714
NT CHF	Nein	CHF	3.948	1.381	2.567

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 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des Teilvermögens oder, falls abweichend, 1/10‘000 (vier Stellen nach dem Komma) der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufliessenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:

   a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;

   b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

   c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;

   d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Pflichtpublikationen

Mitteilung an die Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund II

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

(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

(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.

Die geplanten Änderungen des Fondsvertrags betreffen die geplanten Anlagen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF in das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible aus dem Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 der vorliegenden Veröffentlichung).

Des Weiteren werden bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt. und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF die Angaben betreffend Referenzindex angepasst (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

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

1. Anlagen in den Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V) durch das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible (im Umbrella-Fonds der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" Swisscanto (CH) Index Fund V mit derselben Fondsleitung und Depotbank wie das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF im vorliegenden Umbrella-Fonds) dient als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF im vorliegenden Umbrella-Fonds.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 11 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen dieses Teilvermögens bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible erwerben darf.

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF, für welches das oben erwähnte Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible (Umbrella Swisscanto (CH) Index Fund V) als Zielfonds fungiert, soll gemäss seinen Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile dieses Zielfonds erwerben können (vgl. dazu die vorstehend erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 11 des Fondsvertrages). Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des betreffenden Zielfonds grossen Teils der Anteile durch das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF, 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 betreffenden 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. 15 und § 26 Ziff. 2 des Fondsvertrages aufgenommen.

2. Anpassung der Angaben betreffend Referenzindex bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt. und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

In § 8 Ziff. 16 bzw. Ziff. 18 des Fondsvertrages, in Ziff. 1.2.1 Bst. n bzw. Bst. p des Prospektes sowie in der Tabelle zum Prospekt werden die Angaben betreffend den Referenzindex wie folgt angepasst:

Teilvermögen	Referenzindex bisher	Referenzindex neu
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.	FTSE Non-AUD Non-CAD Non-CHF Non-EMU Non-GBP Non-JPY Non-USD World Government Bond Index	FTSE Non-AUD Non-CAD Non-CHF Non-CNY Non-EMU Non-GBP Non-JPY Non-USD World Government Bond Index
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF	SBI® AAA-BBB Index	SBI® AAA-BBB

***

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis 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 und Ziff. 2 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 in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags 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 II

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

(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

(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.

Beim Hinweis auf die Verpflichtung der Anleger zur Einzahlung des von ihnen gezeichneten Anteils erfolgt eine Ergänzung betreffend Sacheinlagen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem 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. 2 dieser Veröffentlichung).

Des Weiteren wird die Umschreibung des Anlegerkreises der Anteilsklassen C, D, G, M und N angepasst (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 3 dieser Veröffentlichung).

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

1. 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 des von ihnen gezeichneten Anteils in das entsprechende Teilvermögen verpflichtet. Ihre persönliche Haftung für Verbindlichkeiten des Umbrella-Fonds bzw. Teilvermögens ist ausgeschlossen.*"

2. 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).

3. 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.

3.1 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.

3.2 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. 3ter 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. 3ter 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.

3.3 Anteilsklassen G

Anteile der Anteilsklassen 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. 3ter KAG i.V.m. Art. 3 lit. c Ziff. 3 FIDLEG abgeschlossen haben. Anteile der Anteilsklassen 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 Anteilsklassen 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. 3ter 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.

3.4 Anteilsklassen M

Anteile der Anteilsklassen 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 Anteilsklassen umfasst. Die oben genannten Anteilsklassen 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. Die Fondsleitung wird für die Fondsverwaltung (d.h. die Leitung, das Asset Management und, sofern entschädigt, die Vertriebstätigkeit sowie andere anfallende Kosten, insbesondere die Kommissionen und Kosten der Depotbank) nicht über die pauschale Verwaltungskommission, sondern über eine Vergütung, die im Rahmen des oben genannten Anlageberatungsvertrages festgelegt wird, durch die Zürcher Kantonalbank, Zürich entschädigt.

3.5 Anteilsklassen N

Anteile der Anteilsklassen 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 Anteilsklassen 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 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.

***

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis 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. 3 der in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags des Anlagefonds 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 II

mit den Teilvermögen

- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.
- Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH
- Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

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 31. Januar 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 dazugehörenden 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 31. Januar 2022 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, 25. Mai 2022