

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND UK GOVT.

## Jahresbericht per 31.01.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA GBP	21580443	GBP
GT GBP	37925355	GBP
NT GBP	21580445	GBP
ST GBP	30246860	GBP

Rechnungswährung: GBP

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

Zürich, 26. Mai 2023

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zu den Jahresrechnungen des

### Swisscanto (CH) Index Fund II, Zürich

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die 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 zum 31. Januar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, 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), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



### **Grundlage für das Prüfungsurteil**

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



### **Sonstige Informationen**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die in einem Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnungen und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zu den Jahresrechnungen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zu den Jahresrechnungen oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen, dem Fondsvertrag sowie dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

### **Beilage**

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, 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)

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	3
2	Vertriebsorganisation	4
3	Abschlusszahlen	5
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	9
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	10
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	10
7	Pauschale Verwaltungskommission	11
8	Benchmark	11
9	TER	11
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	12
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	12
12	Fussnoten	12
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte Pflichtpublikationen	13 15

# 1 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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied  
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

## Geschäftsleitung

Hans Frey  
Geschäftsführer  
Andreas Hogg  
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services  
Silvia Karrer  
Leiterin Administration & Operations

## Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich  
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022	01.02.2020 31.01.2021	01.02.2019 31.01.2020
<b>Konsolidiert</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		303'190'183.47	85'338'207.58	301'450'292.32	336'930'854.01
<b>Klasse FA GBP</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		7'970'241.70	7'537'191.19	9'504'179.29	5'066'978.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		104'295.372	75'983.039	86'435.671	46'600.837
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		76.4199	99.1957	109.9567	108.7315
Ausschüttung je Anteil		1.85	1.60	2.00	2.20
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.21 %
<b>Klasse GT GBP</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		229'108'772.15	461'393.58	195'976'851.52	229'298'250.58
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'759'224.902	4'329.429	1'680'880.526	2'014'918.012
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		83.0337	106.5715	116.5918	113.8003
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		93.9172	133.1230	142.4284	144.6786
Thesaurierung je Anteil		1.91	1.88	2.16	2.33
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse NT GBP</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		22'747'363.29	29'374'241.09	30'260'054.25	33'950'493.12
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		223'172.542	224'730.566	211'799.683	243'693.050
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		101.9272	130.7087	142.8711	139.3166
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		115.2872	163.2739	174.5312	177.1185
Thesaurierung je Anteil		2.50	2.50	2.85	3.04
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse ST GBP</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		43'363'806.33	47'965'381.72	65'709'207.26	68'615'131.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		485.136	418.456	524.455	561.621
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		89'384.8453	114'624.6719	125'290.4582	122'173.3720
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		101'100.7963	143'182.6332	153'054.6634	155'323.6491
Thesaurierung je Anteil		2'196.91	2'193.91	2'499.56	2'662.62
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

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse FA GBP	-21.60 %	-27.21 %	-5.61 %	9.53 %
Klasse GT GBP	-21.56 %	-27.18 %	-5.55 %	9.59 %
Klasse NT GBP	-21.45 %	-27.08 %	-5.41 %	9.75 %
Klasse ST GBP	-21.45 %	-27.08 %	-5.41 %	9.75 %
Benchmark	-21.50 %	-27.09 %	-5.44 %	9.71 %
Tracking Error 33)	0.07 %	0.06 %	0.05 %	0.07 %

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 Differenz

### Klasse

Klasse FA GBP	-0.10 %
Klasse GT GBP	-0.06 %
Klasse NT GBP	0.05 %
Klasse ST GBP	0.05 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten.

Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2023	31.01.2021
Bankguthaben auf Sicht	1'955'874.90	1'257'395.97
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	300'088'193.54	83'791'772.27
Sonstige Vermögenswerte	1'171'389.61	290'431.29
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>303'215'458.05</b>	<b>85'339'599.53</b>
Andere Verbindlichkeiten	-25'274.58	-1'391.95
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>303'190'183.47</b>	<b>85'338'207.58</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA GBP	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		75'983.039	86'435.671
Ausgegebene Anteile		58'859.766	37'022.083
Zurückgenommene Anteile		-30'547.433	-47'474.715
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>104'295.372</b>	<b>75'983.039</b>

Klasse GT GBP	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'329.429	1'680'880.526
Ausgegebene Anteile		3'603'378.800	242'267.853
Zurückgenommene Anteile		-848'483.327	-1'918'818.950
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'759'224.902</b>	<b>4'329.429</b>

Klasse NT GBP	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		224'730.566	211'799.683
Ausgegebene Anteile		4'765.000	43'275.000
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		9'678.613	-
Zurückgenommene Anteile		-16'001.637	-30'344.117
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>223'172.542</b>	<b>224'730.566</b>

Klasse ST GBP	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		418.456	524.455
Ausgegebene Anteile		189.250	57.159
Zurückgenommene Anteile		-122.570	-163.158
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>485.136</b>	<b>418.456</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT GBP	19.07.2022	1'091'250.07	9'678.613

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		85'338'207.58	301'450'292.32
Ausbezahlte Ausschüttung		-103'834.08	-203'117.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-486'570.24	-2'069'597.31
Saldo aus dem Anteilverkehr		244'975'659.27	-199'516'660.43
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-26'533'279.06	-14'322'710.00
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>303'190'183.47</b>	<b>85'338'207.58</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2022 31.01.2023	01.02.2021 31.01.2022
<b>Ertrag</b>			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-37.65	-101.41
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'546'281.12	3'966'883.73
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		5'023'726.67	212'344.20
<b>Total Ertrag</b>		<b>8'569'970.14</b>	<b>4'179'126.52</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-126'424.42	-182'712.40
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'353'616.66	-2'379'325.44
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'480'041.08</b>	<b>-2'562'037.84</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>7'089'929.06</b>	<b>1'617'088.68</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-11'325'547.75	2'483'923.43
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		306'411.49	20'233.68
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-3'929'207.20</b>	<b>4'121'245.79</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-22'604'071.86	-18'443'955.79
<b>Gesamterfolg</b>		<b>-26'533'279.06</b>	<b>-14'322'710.00</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse FA GBP</b>	<b>31.01.2023</b>	<b>31.01.2022</b>
Nettoertrag	183'004.93	128'650.30
Vortrag des Vorjahres	10'450.41	3'372.98
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>193'455.34</b>	<b>132'023.28</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	192'946.44	121'572.87
Vortrag auf neue Rechnung	508.90	10'450.41
<b>Total</b>	<b>193'455.34</b>	<b>132'023.28</b>
<b>Klasse GT GBP</b>	<b>31.01.2023</b>	<b>31.01.2022</b>
Nettoertrag	5'282'034.80	8'157.54
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>5'282'034.80</b>	<b>8'157.54</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'848'712.18	2'855.14
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'433'322.62	5'302.40
<b>Total</b>	<b>5'282'034.80</b>	<b>8'157.54</b>
<b>Klasse NT GBP</b>	<b>31.01.2023</b>	<b>31.01.2022</b>
Nettoertrag	559'088.00	562'223.14
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>559'088.00</b>	<b>562'223.14</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	195'680.80	196'778.10
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	363'407.20	365'445.04
<b>Total</b>	<b>559'088.00</b>	<b>562'223.14</b>
<b>Klasse ST GBP</b>	<b>31.01.2023</b>	<b>31.01.2022</b>
Nettoertrag	1'065'801.33	918'057.70
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>1'065'801.33</b>	<b>918'057.70</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	373'030.47	321'320.20
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	692'770.86	596'737.50
<b>Total</b>	<b>1'065'801.33</b>	<b>918'057.70</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert GBP	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>300'088'193.54</b>	<b>98.97</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>300'088'193.54</b>	<b>98.97</b>	
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	1'120	4'400	1'380	4'140	GBP 114.02%	4'720'428.00	1.56	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	1'684	7'000	1'424	7'260	GBP 107.32%	7'791'432.00	2.57	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	1'792	6'370	1'490	6'672	GBP 103.53%	6'907'521.60	2.28	a)
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	1'415	6'065	1'358	6'122	GBP 106.60%	6'526'052.00	2.15	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	1'262	5'469	1'148	5'583	GBP 112.29%	6'269'150.70	2.07	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	1'494	6'579	1'835	6'238	GBP 110.30%	6'880'514.00	2.27	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	1'496	7'186	2'491	6'191	GBP 106.85%	6'615'083.50	2.18	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	1'368	6'000	1'782	5'586	GBP 104.47%	5'835'694.20	1.92	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	1'642	7'120	1'996	6'766	GBP 110.00%	7'442'600.00	2.45	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	1'528	6'570	1'399	6'699	GBP 110.20%	7'382'298.00	2.43	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	1'152	5'230	1'663	4'719	GBP 107.82%	5'088'025.80	1.68	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	1'131	4'610	1'041	4'700	GBP 106.06%	4'984'820.00	1.64	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	1'102	4'800	1'009	4'893	GBP 109.60%	5'362'728.00	1.77	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	1'105	5'014	1'402	4'717	GBP 107.56%	5'073'605.20	1.67	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	1'292	5'496	1'259	5'529	GBP 106.09%	5'865'716.10	1.93	a)
GB00B6RNH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	1'212	4'620	1'130	4'702	GBP 100.33%	4'717'516.60	1.56	a)
GB00B7Z53659	2.2500 % UKT 2 1/4 09/07/23	1'528	4'700	6'228	0	GBP 0.00%	0.00	0.00	
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	1'775	9'397	3'631	7'541	GBP 92.07%	6'942'998.70	2.29	a)
GB00BBJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	1'400	5'915	1'626	5'689	GBP 98.26%	5'590'011.40	1.84	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	1'648	7'001	1'777	6'872	GBP 63.23%	4'345'165.60	1.43	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	1'643	7'555	2'304	6'894	GBP 63.91%	4'405'955.40	1.45	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	1'106	5'070	980	5'196	GBP 91.87%	4'773'565.20	1.57	a)
GB00BF0HZ991	0.7500 % UKT 0 3/4 07/22/23	2'028	130	2'158	0	GBP 0.00%	0.00	0.00	
GB00BFMCN652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	1'055	5'028	1'418	4'665	GBP 57.01%	2'659'516.50	0.88	a)
GB00BFWFPL34	1.0000 % UKT 1 04/22/24	1'554	6'230	1'950	5'834	GBP 97.08%	5'663'647.20	1.87	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	964	4'340	1'064	4'240	GBP 67.06%	2'843'344.00	0.94	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	983	4'620	950	4'653	GBP 91.75%	4'269'127.50	1.41	a)
GB00BH8FH458	2.7500 % UKT 2 3/4 09/07/24	1'151	4'220	900	4'471	GBP 98.91%	4'422'266.10	1.46	a)
GB00BJLROJ16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	1'157	5'310	1'460	5'007	GBP 61.64%	3'086'314.80	1.02	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	1'419	5'150	1'110	5'459	GBP 85.78%	4'682'730.20	1.54	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	2'040	9'250	2'595	8'695	GBP 66.42%	5'775'219.00	1.90	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	1'170	5'770	1'200	5'740	GBP 94.24%	5'409'376.00	1.78	a)
GB00BL68HG94	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/23	2'021	0	2'021	0	GBP 0.00%	0.00	0.00	
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	1'360	5'800	1'325	5'835	GBP 80.30%	4'685'505.00	1.55	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	1'174	5'320	1'120	5'374	GBP 91.43%	4'913'448.20	1.62	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	0	6'090	0	6'090	GBP 102.46%	6'239'814.00	2.06	a)
GB00BLBDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	0	4'848	1'170	3'678	GBP 45.39%	1'669'444.20	0.55	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	562	9'486	1'340	8'708	GBP 56.99%	4'962'689.20	1.64	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	0	13'421	2'320	11'101	GBP 93.70%	10'401'637.00	3.43	a)
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	250	7'988	1'170	7'068	GBP 84.71%	5'987'302.80	1.97	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	700	6'492	1'241	5'951	GBP 68.70%	4'088'337.00	1.35	a)
GB00BM8Z2S21	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	847	5'405	890	5'362	GBP 77.31%	4'145'362.20	1.37	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	0	14'646	1'560	13'086	GBP 81.61%	10'679'484.60	3.52	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	500	3'610	469	3'641	GBP 60.00%	2'184'600.00	0.72	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	1'269	6'364	1'302	6'331	GBP 37.00%	2'342'470.00	0.77	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	933	3'750	877	3'806	GBP 47.18%	1'795'670.80	0.59	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	1'343	5'070	1'218	5'195	GBP 85.72%	4'453'154.00	1.47	a)
GB00BMGR2791	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/24	3'070	11'320	3'005	11'385	GBP 96.64%	11'002'464.00	3.63	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	2'433	9'670	2'243	9'860	GBP 77.26%	7'617'836.00	2.51	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	1'796	7'644	1'796	7'644	GBP 70.44%	5'384'433.60	1.78	a)
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	0	1'700	200	1'500	GBP 98.43%	1'476'405.00	0.49	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	1'768	7'473	2'048	7'193	GBP 95.46%	6'866'437.80	2.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Währ- ung 31.01.2023	Kurs 8)	Kurswert GBP	in % 7)	Kat.
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	1'053	9'223	1'660	8'616	GBP	89.89%	7'744'922.40	2.55 a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	1'004	6'549	1'479	6'074	GBP	55.68%	3'382'003.20	1.12 a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	0	1'200	0	1'200	GBP	100.11%	1'201'344.00	0.40 a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	0	2'300	150	2'150	GBP	100.21%	2'154'515.00	0.71 a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	0	2'180	0	2'180	GBP	100.17%	2'183'706.00	0.72 a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	1'110	4'900	1'014	4'996	GBP	97.01%	4'846'619.60	1.60 a)
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	1'338	6'128	1'895	5'571	GBP	76.62%	4'268'667.33	1.41 a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	1'689	4'930	1'130	5'489	GBP	94.38%	5'180'463.31	1.71 a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	1'808	7'470	1'738	7'540	GBP	78.21%	5'897'034.00	1.94 a)
<b>GBP</b>							<b>300'088'193.54</b>	<b>98.97</b>	

#### Derivative Finanzinstrumente

**0.00 0.00**

#### Devisentermingeschäfte

GBP/CHF	Verfall 28.12.2022	820'000	731'198	CHF/GBP	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 29.12.2022	40'000	35'745	CHF/GBP	0.00	0.00

#### Devisentermingeschäfte

**0.00 0.00**

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert GBP	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'955'874.90	0.65
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	300'088'193.54	98.97
Sonstige Vermögenswerte	1'171'389.61	0.39
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>303'215'458.05</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-25'274.58	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>303'190'183.47</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert GBP	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);	300'088'193.54	98.97
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

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

CHF	1 = GBP	0.88411614
-----	---------	------------

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	GBP	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	GBP	-	-

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2022 - 31.01.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA GBP	GBP	0.00 - 0.15	-	0.049	-	-	-
GT GBP	GBP	0.00 - 0.15	-	0.049	-	-	-
NT GBP	GBP	0.00 - 0.15	-	0.049	-	-	-
ST GBP	GBP	0.00 - 0.15	-	0.049	-	-	-

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.

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	GBP	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	GBP	-
Andere Wertpapiere	GBP	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	GBP	-

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.02.2022 - 31.01.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
FA GBP	0.200	0.500	0.100	0.100	-
GT GBP	0.140	0.350	0.090	0.050	-
NT GBP	-	-	-	-	-
ST GBP	-	-	-	-	-

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

## 8 Benchmark

FTSE UK Government Bond Index

## 9 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.

## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 15.05.2023

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.05.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA GBP	Ja	GBP	1.85000	0.64750	1.2025

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 15.05.2023

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.05.2023

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT GBP	Ja	GBP	1.914	0.669	1.245
NT GBP	Ja	GBP	2.505	0.876	1.629
ST GBP	Ja	GBP	2'196.91	768.91	1'428.00

## 12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-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.
- 28) 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.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe 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 Anteils-klassen (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.

**Mitteilung an die Anleger**

des

**Swisscanto (CH) Index Fund II**

ein 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.

Im Fondsvertrag werden bestehende Anteilsklassen umbenannt (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Überdies erfolgt eine Anpassung bei einer Risikoverteilungsvorschrift (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich wird die Umwandlung im Fondsvertrag neu nicht mehr geregelt (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 Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

### 1. Umbenennung von Anteilsklassen

Die bestehenden Anteilsklassen mit Währungsabsicherung werden wie folgt umbenannt (vgl. § 6 Ziff. 4 und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages):

<b>Bisherige Anteilsklassenbezeichnung</b>	<b>Neue Anteilsklassenbezeichnung</b>
FTH CHF	FTH1 CHF
FTH EUR	FTH1 EUR
FTH GBP	FTH1 GBP
FTH USD	FTH1 USD
FAH CHF	FAH1 CHF
FAH EUR	FAH1 EUR
FAH GBP	FAH1 GBP
FAH USD	FAH1 USD
CTH CHF	CTH1 CHF
CTH EUR	CTH1 EUR
CTH GBP	CTH1 GBP
CTH USD	CTH1 USD
CAH CHF	CAH1 CHF
CAH EUR	CAH1 EUR
CAH GBP	CAH1 GBP
CAH USD	CAH1 USD
DTH CHF	DTH1 CHF
DTH EUR	DTH1 EUR
DTH GBP	DTH1 GBP
DTH USD	DTH1 USD
DAH CHF	DAH1 CHF

DAH EUR	DAH1 EUR
DAH GBP	DAH1 GBP
DAH USD	DAH1 USD
GTH CHF	GTH1 CHF
GTH EUR	GTH1 EUR
GTH GBP	GTH1 GBP
GTH USD	GTH1 USD
GAH CHF	GAH1 CHF
GAH EUR	GAH1 EUR
GAH GBP	GAH1 GBP
GAH USD	GAH1 USD
MTH CHF	MTH1 CHF
MTH EUR	MTH1 EUR
MTH GBP	MTH1 GBP
MTH USD	MTH1 USD
MAH CHF	MAH1 CHF
MAH EUR	MAH1 EUR
MAH GBP	MAH1 GBP
MAH USD	MAH1 USD
NTH CHF	NTH1 CHF
NTH EUR	NTH1 EUR
NTH GBP	NTH1 GBP
NTH USD	NTH1 USD
NAH CHF	NAH1 CHF
NAH EUR	NAH1 EUR
NAH GBP	NAH1 GBP
NAH USD	NAH1 USD
STH CHF	STH1 CHF

STH EUR	STH1 EUR
STH GBP	STH1 GBP
STH USD	STH1 USD
SAH CHF	SAH1 CHF
SAH EUR	SAH1 EUR
SAH GBP	SAH1 GBP
SAH USD	SAH1 USD

## 2. Anpassung Risikoverteilungsvorschrift

§ 15 Ziff. 10 des Fondsvertrages lautet neu wie folgt:

"Die Fondsleitung darf keine Beteiligungsrechte erwerben, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben. Vorbehalten bleiben die durch die Aufsichtsbehörde gewährten Ausnahmen."

## 3. Keine Regelung der Umwandlung mehr

Bisher wurde in § 25 des Fondsvertrages nebst der Vereinigung und Spaltung auch die Umwandlung geregelt. Die betreffenden Angaben betreffend die Umwandlung werden nun entfernt (vgl. die Streichung in der Überschrift von § 25 des Fondsvertrages und in § 25 Ziff. 9 des Fondsvertrages).

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA lediglich auf die in Ziff. 1 und Ziff. 2 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 in bar verlangen können.

Kein Einwendungsrecht besteht gegen die in Ziff. 2 umschriebenen Änderungen, da es sich bei den Änderungen um rein formelle Anpassungen handelt.

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, 29. Juni 2022

### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich