

# SWISSCANTO (CH) IPF IV RESPONSIBLE PORTFOLIO 95

## Jahresbericht per 31.05.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund IV (IPF IV)  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
ASTT BVG CHF	56015460	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. September 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund IV (IPF IV),

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 15
- ▶ Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25
- ▶ Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45
- ▶ Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75
- ▶ Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 95

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Mai 2024, 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 beigelegten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag.



#### 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.



### **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 sowie dem Fondsvertrag 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 Unvollständigkeits, 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. Mai 2024, 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	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	9
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	9
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	10
7	Pauschale Verwaltungskommission	10
8	Benchmark	10
9	TER	10
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	11
11	Fussnoten	11
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	12
13	Pflichtpublikationen	14

# 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  
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	01.06.2023	01.06.2022	01.06.2021	30.11.2020
	bis	31.05.2024	31.05.2023	31.05.2022	31.05.2021
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		274'910'989.90	162'084'636.02	100'584'961.71	17'883'947.42
<b>Klasse ASTT BVG CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		274'910'989.90	162'084'636.02	100'584'961.71	17'883'947.42
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'146'518.169	1'451'954.068	881'419.584	155'487.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		128.0730	111.6321	114.1170	115.0200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		128.1626	111.7102	114.2083	115.0200
Thesaurierung je Anteil		1.67	1.28	0.92	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.76 %	0.75 %	0.77 %	0.78 %

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

#### Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse ASTT BVG CHF	14.73 %	10.34 %	-17.07 %	22.90 %

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.

#### Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.05.2024	31.05.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'093'914.79	4'771'355.95
Bankguthaben auf Zeit	0.00	1'371'225.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	273'421'816.05	156'039'287.08
Derivative Finanzinstrumente	48'052.99	-216'819.16
Sonstige Vermögenswerte	519'018.20	228'524.91
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>275'082'802.03</b>	<b>162'193'573.78</b>
Andere Verbindlichkeiten	-171'812.13	-108'937.76
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>274'910'989.90</b>	<b>162'084'636.02</b>

#### Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse ASTT BVG CHF	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'451'954.068	881'419.584
Ausgegebene Anteile		706'962.298	574'465.329
Zurückgenommene Anteile		-12'398.197	-3'930.845
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'146'518.169</b>	<b>1'451'954.068</b>



## Veränderung des Nettofondsvermögens

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.06.2023 31.05.2024</b>	<b>01.06.2022 31.05.2023</b>
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		162'084'636.02	100'584'961.71
Saldo aus dem Anteilverkehr		80'564'060.46	60'947'867.19
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		32'262'293.42	551'807.12
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>274'910'989.90</b>	<b>162'084'636.02</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.06.2023 31.05.2024</b>	<b>01.06.2022 31.05.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		43'620.21	25'631.29
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-2.40	-2'195.15
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		4'050'918.37	2'058'956.32
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'064'779.29	716'639.90
<b>Total Ertrag</b>		<b>5'159'315.47</b>	<b>2'799'032.36</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-13.85	0.00
Reglementarische Vergütungen		-1'539'319.88	-927'705.71
Sonstige Aufwendungen		-137.77	-243.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-16'907.98	-2'426.68
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'556'379.48</b>	<b>-930'375.39</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>3'602'935.99</b>	<b>1'868'656.97</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'037'770.79	-1'137'136.39
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		63'487.45	44'302.31
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-1'371'347.35</b>	<b>775'822.89</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		33'633'640.77	-224'015.77
<b>Gesamterfolg</b>		<b>32'262'293.42</b>	<b>551'807.12</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse ASTT BVG CHF</b>	<b>31.05.2024</b>	<b>31.05.2023</b>
Nettoertrag	3'602'935.99	1'868'656.97
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>3'602'935.99</b>	<b>1'868'656.97</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'602'935.99	1'868'656.97
<b>Total</b>	<b>3'602'935.99</b>	<b>1'868'656.97</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>15'430'716.48</b>	<b>5.61</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>15'430'716.48</b>	<b>5.61</b>	
IE00BL25JP72	X MSCI WORLD MOMENTUM 1C	0	139'386	44'726	94'660 USD	62.53	5'339'906.86	1.94	a)
<b>CH</b>							<b>5'339'906.86</b>	<b>1.94</b>	
IE00BJ5JP105	ISHARES MSCI WD ENERGY-USD D	0	573'905	0	573'905 EUR	6.72	3'777'655.08	1.37	a)
<b>DE</b>							<b>3'777'655.08</b>	<b>1.37</b>	
IE0007UJ6IE0	IVZ US INSURANCE ACC	0	617'353	0	617'353 USD	6.79	3'779'707.30	1.37	a)
IE00BNRQM384	INVESCO NASDAQ-100 SWAP ACC	0	136'261	86'768	49'493 USD	56.74	2'533'447.24	0.92	a)
<b>GB</b>							<b>6'313'154.54</b>	<b>2.30</b>	
IE00BM67HN09	X MSCI WORLD CONSUMER STAPL	0	79'541	79'541	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>US</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>							<b>257'991'099.57</b>	<b>93.79</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>257'991'099.57</b>	<b>93.79</b>	
CH0192251772	SWC (CH) EF RESP SMC SWITZERLAND (I) NT CHF	18'789	21'576	11'675	28'689 CHF	233.22	6'691'004.05	2.43	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	0	59'075	0	59'075 CHF	169.30	10'001'249.47	3.64	a)
CH0224705639	SWC (CH) PBF RESPON DOMESTIC CHF NT CHF	23'808	23'031	46'840	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0224706454	SWC (CH) PEF RESPONSIBLE SWITZERLAND NT CHF	222'678	118'440	56'659	284'459 CHF	175.92	50'041'035.09	18.19	a)
CH0414225430	SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD	111	20	95	36 USD	210'965.66	6'913'661.19	2.51	a)
CH0414225505	SWC (CH) IPF I EF SYST RESP WORLD ENH ST CHF	273	148	26	394 CHF	151'842.20	59'829'320.79	21.75	a)
CH0461413939	SWC (CH) IEF UNITED KINGDOM NT GBP	11'501	35'239	11'501	35'239 GBP	132.82	5'376'168.82	1.95	a)
CH0527915919	SWC(CH)IPF I INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH ST CHF	0	13	13	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0555645537	SWC (CH) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT CHF	0	102'437	0	102'437 CHF	109.58	11'224'727.37	4.08	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPON. GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	51'659	77'945	0	129'604 CHF	85.20	11'041'740.69	4.01	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	38'518	99'503	11'775	126'246 CHF	94.82	11'970'122.36	4.35	a)
CH0568203662	SWC (CH) IPF II EF RESPONSIBLE WLD EX CH ST CHF	267	142	33	376 CHF	146'111.80	54'986'398.15	19.99	a)
CH0568203746	SWC (CH) IPF II EF SUSTAINABLE ST CHF	171	87	61	197 CHF	151'914.81	29'915'671.59	10.88	a)
<b>CH</b>							<b>257'991'099.57</b>	<b>93.79</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>48'052.99</b>	<b>0.02</b>	
<b>Optionen und Optionsscheine</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
DE000C7P2H50	NESE 03/15/24 P110	80	0	80	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		50'813'774	55'981'110		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		810'524	892'947		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		1'251'572	191'946'196		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		1'830'790	280'777'508		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		2'748'466	2'447'181		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		985'191	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		12'407'745	12'787'047		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		2'133'420	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 05.07.2023		3'426'209	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		826'022	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		748'541	9'010'102		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		1'132'662	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		581'269	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		1'811'757	1'762'898		EUR/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.08.2023		2'776'980	2'447'181		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 08.08.2023		1'878'931	2'132'149		GBP/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.08.2023		2'937'954	472'723'704		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.08.2023		831'594	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		50'933'107	56'874'057		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 08.08.2023		1'117'548	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.08.2023		10'718'205	10'975'290		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 08.08.2023		3'360'082	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 08.08.2023		998'541	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.08.2023		745'937	9'010'102		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.08.2023		2'164'797	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.08.2023		574'941	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		2'846'768	3'188'699		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.09.2023		52'550'647	60'062'756		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.09.2023		10'522'197	10'975'290		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.09.2023		631'517	568'250		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.09.2023		2'450'111	2'206'047		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 01.09.2023		815'450	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 01.09.2023		738'243	9'010'102		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 01.09.2023		3'341'895	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.09.2023		960'346	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.09.2023		2'908'740	472'723'704		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.09.2023		2'096'091	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 01.09.2023		1'094'392	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.09.2023		565'099	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		3'079'187	2'774'297		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		727'151	9'010'102		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		52'677'800	60'062'756		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		2'848'071	472'723'704		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.10.2023		3'359'866	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.10.2023		950'032	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		2'072'772	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.10.2023		813'276	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		10'491'664	10'975'290		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		1'093'493	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		562'720	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		54'765'822	60'062'756		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		2'738'862	2'497'322		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		976'823	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		2'147'952	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		10'552'105	10'975'290		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.11.2023		3'474'150	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		2'891'873	472'723'704		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		3'074'936	2'774'297		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		748'118	9'010'102		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		817'383	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		1'138'114	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		577'069	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.12.2023		51'553'785	57'323'894		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.12.2023		3'043'243	2'774'297		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 01.12.2023		3'431'950	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.12.2023		10'542'633	10'975'290		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.12.2023		959'826	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.12.2023		2'086'441	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 01.12.2023		571'888	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 01.12.2023		731'287	9'010'102		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.12.2023		2'835'907	472'723'704		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 01.12.2023		1'124'514	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 01.12.2023		815'678	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 01.12.2023		2'132'360	172'365		SEK/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		50'036'995	57'323'894		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.01.2024		3'075'686	2'774'297		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.01.2024		10'543'983	10'975'290		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 05.01.2024		3'329'511	3'663'974		EUR/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		2'818'194	472'723'704		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.01.2024		970'324	1'673'593		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.01.2024		2'063'698	3'205'018		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.01.2024		817'186	6'338'463		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.01.2024		581'884	6'877'742		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.01.2024		569'815	867'080		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.01.2024		1'093'914	9'770'226		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		2'634'156	3'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.01.2024		5'060'291	5'768'982		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.06.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.05.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USD/CHF	Verfall 05.01.2024		2'870'437	3'312'397	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2024		4'413'657	5'181'249	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		2'547'141	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'974'702	2'325'787	CHF/USD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.02.2024		555'620	867'080	CHF/SGD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		60'780'322	71'586'522	CHF/USD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2024		790'622	6'338'463	CHF/DKK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2024		571'513	6'877'742	CHF/SEK		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'063'421	9'770'226	CHF/HKD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2024		959'846	1'673'593	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		2'042'266	3'205'018	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.02.2024		3'346'581	3'663'974	EUR/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024		2'974'496	2'774'297	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2024		2'825'810	472'723'704	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		10'201'203	10'975'290	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'847'312	2'173'265	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'218'507	1'913'668	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		3'123'658	3'598'187	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		2'579'127	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		68'504'846	79'683'761	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		5'124'725	5'961'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		4'014'556	4'308'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		10'227'697	10'975'290	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.03.2024		948'601	1'673'593	CHF/AUD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.03.2024		2'764'450	472'723'704	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.03.2024		3'281'503	5'118'686	CHF/CAD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.03.2024		792'720	6'338'463	CHF/DKK		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.03.2024		557'172	867'080	CHF/SGD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.03.2024		3'380'758	3'663'974	EUR/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.03.2024		3'023'065	2'774'297	CHF/GBP		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'075'467	9'770'226	CHF/HKD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.03.2024		568'583	6'877'742	CHF/SEK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		3'907'283	4'578'935	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.03.2024		4'929'544	4'303'748	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2024		14'527'975	15'283'290	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.04.2024		3'075'602	2'774'297	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.04.2024		3'374'114	3'663'974	EUR/USD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.04.2024		808'826	6'338'463	CHF/DKK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.04.2024		953'498	1'673'593	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		74'651'404	85'294'152	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		2'625'669	3'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		2'469'609	2'821'691	CHF/USD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.04.2024		565'341	867'080	CHF/SGD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.04.2024		2'775'318	472'723'704	CHF/JPY		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.04.2024		583'198	6'877'742	CHF/SEK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.04.2024		3'300'380	5'118'686	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/JPY	Verfall 04.04.2024		472'723'704	3'208'986	JPY/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.04.2024		3'540'379	596'039'409	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/USD	Verfall 04.04.2024		3'186'234	472'723'704	USD/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		2'514'698	2'777'720	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.04.2024		1'673'593	989'853	AUD/CHF		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.04.2024		1'093'542	9'770'226	CHF/HKD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		14'822'728	15'283'290	CHF/EUR		-113'287.94	-0.04	b)
JPY/CHF	Verfall 02.07.2024		2'839'911	472'723'704	CHF/JPY		122'630.26	0.04	b)
JPY/CHF	Verfall 02.07.2024		3'580'737	596'039'409	CHF/JPY		154'619.85	0.06	b)
GBP/CHF	Verfall 02.07.2024		3'134'284	2'774'297	CHF/GBP		-41'478.94	-0.02	b)
AUD/CHF	Verfall 02.07.2024		980'563	1'673'593	CHF/AUD		-20'884.24	-0.01	b)
CHF/AUD	Verfall 02.07.2024		1'673'593	980'563	AUD/CHF		20'884.24	0.01	b)
CAD/CHF	Verfall 02.07.2024		3'395'122	5'118'686	CHF/CAD		17'448.78	0.01	b)
DKK/CHF	Verfall 02.07.2024		824'926	6'338'463	CHF/DKK		-5'826.53	0.00	b)
SGD/CHF	Verfall 02.07.2024		578'648	867'080	CHF/SGD		1'168.57	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 02.07.2024		576'933	6'877'742	CHF/SEK		-11'839.56	0.00	b)
HKD/CHF	Verfall 02.07.2024		1'125'061	9'770'226	CHF/HKD		1'455.25	0.00	b)
USD/EUR	Verfall 02.07.2024		3'396'739	3'663'974	EUR/USD		25'714.18	0.01	b)
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		2'496'512	2'777'720	CHF/USD		-603.98	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		81'891'548	91'115'843	CHF/USD		-19'812.04	-0.01	b)
GBP/USD	Verfall 02.07.2024		5'484'888	4'393'260	USD/GBP		-98'158.37	-0.04	b)
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		6'779'380	7'523'341	CHF/USD		16'023.46	0.01	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>48'052.99</b>	<b>0.02</b>	

<b>Vermögensaufstellung</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
Bankguthaben auf Sicht		1'093'914.79	0.40
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		273'421'816.05	99.40
Derivative Finanzinstrumente		48'052.99	0.02
Sonstige Vermögenswerte		519'018.20	0.19
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>275'082'802.03</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten		-171'812.13	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>274'910'989.90</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	273'421'816.05	99.40
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	48'052.99	0.02
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

AUD	1 = CHF	0.59997486
CAD	1 = CHF	0.66181271
DKK	100 = CHF	13.13039400
EUR	1 = CHF	0.97937361
GBP	1 = CHF	1.14861738
HKD	100 = CHF	11.53150500
JPY	100 = CHF	0.57408800
NOK	100 = CHF	8.59063700
SEK	100 = CHF	8.57785300
SGD	1 = CHF	0.66741881
USD	1 = CHF	0.90215000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

<b>Engagement</b>	<b>Währung</b>	<b>Betrag</b>	<b>in % 28)</b>
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	9'278'982.35	3.375
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	131'654'498.85	47.890

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

Periode: 01.06.2023 - 31.05.2024

<b>Klasse</b>	<b>Währung</b>	<b>Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)</b>		<b>Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)</b>	
		<b>Teilvermögen</b>	<b>Fondsleitung</b>	<b>Teilvermögen</b>	<b>Fondsleitung</b>
ASTT BVG CHF	CHF	-	-	-	-

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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: 01.06.2023 - 31.05.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
ASTT BVG CHF	0.750	1.200	0.650	0.100	5.000

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

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 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 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 17.09.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 20.09.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
ASTT BVG CHF 34)	Nein	CHF	1.678	-	1.678

## 11 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.
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

## 12 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 gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern 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 Anteilsklasse 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Anteilsklasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit der jeweiligen Anteilsklasse gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% 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 des Teilvermögens 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 Anhang näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach



Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, 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 Anhang zum Fondsvertrag genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zu-zurechnen 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 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 Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

## **Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger**

des

### **Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund IV (IPF IV)**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10

Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25

Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45

Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75

Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 95

(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 Anpassungen des Fondsvertrages haben insbesondere Änderungen sowie Präzisierung der Anlagepolitik der einzelnen Teilvermögen zum Ziel (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Schliesslich erfolgen Anpassungen in den Risikoverteilungsvorschriften (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## **1 Änderung der Anlagepolitik**

### **1.1 Anpassung bzw. Präzisierung bei sämtlichen Teilvermögen des Umbrella-Fonds**

Die Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 2 A Bst. ba, § 8 Ziff. 2 B Bst. ba, § 8 Ziff. 2 C Bst. ba, § 8 Ziff. 2 D Bst. bb sowie § 8 Ziff. 2 E Bst. bb des Fondsvertrages präzisiert werden.

In den erwähnten Bestimmungen werden bei der beispielhaften Aufzählung der zulässigen Anlageinstrumente neu auch Bail-in Bonds explizit aufgeführt.

In den angepassten Bestimmungen ist damit neu jeweils festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Notes, Bail-in Bonds, Forderungswertpapiere aus einer Verbriefung, wie zum Beispiel Schweizer Pfandbriefe, ABS und MBS sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldner zu den zulässigen Anlagen gehören.

### **1.2 Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10**

Nach § 8 Ziff. 2 A Bst. c des Fondsvertrages hat die Fondsleitung diverse Anlagebeschränkungen, die sich auf das Gesamtvermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten.

Neu wird eine Bestimmung aufgenommen, wonach die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte höchstens 95% betragen darf (vgl. § 8 Ziff. 2 A Bst. ca des angepassten Fondsvertrages).

Zudem wird die Bestimmung in Ziff. 2 A Bst. cb von § 8 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Neu beträgt die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte in Schweizer Franken (CHF) höchstens 61%.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 A Bst. cc des angepassten Fondsvertrages erfährt ebenfalls eine Änderung. Neu wird ausgeführt, dass höchstens 34% in Forderungswertpapiere und -rechte in Fremdwährungen investiert werden darf.

Des Weiteren wird die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 A Bst. ch des angepassten Fondsvertrages angepasst. Die Quote für Beteiligungswertpapiere und - von inländischen Gesellschaften beträgt neu höchstens 10%.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 A Bst. ci des angepassten Fondsvertrages erfährt ausserdem eine Anpassung. Neu dürfen höchstens 15% in Beteiligungswertpapiere und -rechte von ausländischen Gesellschaften investiert werden.

Abschliessend wird auch die Quote in § 8 Ziff. 2 A Bst. co des angepassten Fondsvertrages angepasst. Neu darf höchstens 65% in Anteile von aufgeführten Zielfonds investiert werden. In der gleichen Bestimmung wird neu der Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF) des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Investment Fund I als zulässiger Zielfonds aufgenommen.

### 1.3 Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25

Nach § 8 Ziff. 2 B Bst. c des Fondsvertrages hat die Fondsleitung diverse Anlagebeschränkungen, die sich auf das Gesamtvermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten.

Neu wird eine Bestimmung aufgenommen, wonach die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte höchstens 80% betragen darf (vgl. § 8 Ziff. 2 B Bst. ca des angepassten Fondsvertrages).

Zudem wird die Bestimmung in Ziff. 2 B Bst. cb von § 8 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Neu beträgt die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte in Schweizer Franken (CHF) höchstens 50%.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 B Bst. cc des angepassten Fondsvertrages erfährt ebenfalls eine Änderung. Neu wird ausgeführt, dass höchstens 30% in Forderungswertpapiere und -rechte in Fremdwährungen investiert werden darf.

Des Weiteren wird die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 B Bst. ch des angepassten Fondsvertrages angepasst. Die Quote für Beteiligungswertpapiere und - von inländischen Gesellschaften beträgt neu höchstens 20%.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 B Bst. ci des angepassten Fondsvertrages erfährt ausserdem eine Anpassung. Neu dürfen höchstens 25% in Beteiligungswertpapiere und -rechte von ausländischen Gesellschaften investiert werden.

Abschliessend wird auch die Quote in § 8 Ziff. 2 B Bst. co des angepassten Fondsvertrages angepasst. Neu darf höchstens 50% in Anteile von aufgeführten Zielfonds investiert werden.

### 1.4 Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45

Nach § 8 Ziff. 2 C Bst. c des Fondsvertrages hat die Fondsleitung diverse Anlagebeschränkungen, die sich auf das Gesamtvermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten.

Neu wird eine Bestimmung aufgenommen, wonach die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte höchstens 60% betragen darf (vgl. § 8 Ziff. 2 C Bst. ca des angepassten Fondsvertrages).

Zudem wird die Bestimmung in Ziff. 2 C Bst. cb von § 8 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Neu beträgt die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte in Schweizer Franken (CHF) höchstens 36%.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 C Bst. cc des angepassten Fondsvertrages erfährt ebenfalls eine Änderung. Neu wird ausgeführt, dass höchstens 24% in Forderungswertpapiere und -rechte in Fremdwährungen investiert werden darf.

Des Weiteren wird die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 C Bst. ch des angepassten Fondsvertrages angepasst. Die Quote für Beteiligungswertpapiere und - von inländischen Gesellschaften beträgt neu höchstens 28%.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 C Bst. ci des angepassten Fondsvertrages erfährt ausserdem eine Anpassung. Neu dürfen höchstens 37% in Beteiligungswertpapiere und -rechte von ausländischen Gesellschaften investiert werden.

Abschliessend kommt es in § 8 Ziff. 2 C Bst. co des angepassten Fondsvertrages zu einer Anpassung. Gemäss dieser Bestimmung dürfen 40% in Anteile von aufgeführten Zielfonds investiert werden. Neu werden die Zielfonds Swisscanto (CH) IPF I Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I)) sowie Swisscanto (CH) IPF II Equity Fund Responsible World ex CH (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund II (IPF II)) aufgenommen. Der Zielfonds Swisscanto (CH) Pension Equity Fund Switzerland (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Pension Fund) ist hingegen nicht mehr vorgesehen und wird entsprechend gestrichen.

### 1.5 Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75

Nach § 8 Ziff. 2 D Bst. c des Fondsvertrages hat die Fondsleitung diverse Anlagebeschränkungen, die sich auf das Gesamtvermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten.

Neu wird eine Bestimmung aufgenommen, wonach die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte höchstens 35% betragen darf (vgl. § 8 Ziff. 2 D Bst. cd des angepassten Fondsvertrages).

Des Weiteren wird die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 D Bst. cb des Fondsvertrages angepasst. Die Quote für Beteiligungswertpapiere und - von inländischen Gesellschaften beträgt neu höchstens 32%.

Abschliessend erfährt die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 D Bst. cc des Fondsvertrages eine Anpassung. Neu dürfen höchstens 63% in Beteiligungswertpapiere und -rechte von ausländischen Gesellschaften investiert werden.

### 1.6 Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 95

Nach § 8 Ziff. 2 E Bst. c des Fondsvertrages hat die Fondsleitung diverse Anlagebeschränkungen, die sich auf das Gesamtvermögen des Teilvermögens beziehen, einzuhalten.

Neu wird eine Bestimmung aufgenommen, wonach die Quote für Forderungswertpapiere und -rechte höchstens 15% betragen darf (vgl. § 8 Ziff. 2 E Bst. cd des angepassten Fondsvertrages).

Des Weiteren wird die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 E Bst. cb des Fondsvertrages angepasst. Die Quote für Beteiligungswertpapiere und - von inländischen Gesellschaften beträgt neu höchstens 34%.

Abschliessend erfährt die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 E Bst. cc des Fondsvertrages eine Anpassung. Neu dürfen höchstens 81% in Beteiligungswertpapiere und -rechte von ausländischen Gesellschaften investiert werden.

## 2 Änderung in der Risikoverteilung

### 2.1 Anpassung bei sämtlichen Teilvermögen des Umbrella-Fonds

Bis anhin wurde in § 15 Ziff. 3 des Fondsvertrages ausgeführt, dass die Fondsleitung einschliesslich der Derivate höchstens 10% des Vermögens des jeweiligen Teilvermögens in Forderungswertpapiere und -rechte sowie Geldmarktinstrumente desselben Emittenten anlegen darf. Neu wird im Einklang mit dem Musterfondsvertrag der Asset Management Association Switzerland AMAS ausgeführt, dass sich diese Quote auf Effekten sowie Geldmarktinstrumente desselben Emittenten bezieht.

### 2.2 Anpassungen bei Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10 und Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45

Für die Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10 und Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45 soll der Maximalsatz für Investitionen in Forderungen gegenüber schweizerischen Pfandbriefinstitute (einschliesslich der Derivate) neu höchstens 50% des Vermögens des jeweiligen Teilvermögens betragen (vgl. § 15 Ziff. 3 Bst. b des Fondsvertrages).

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10 als Dachfonds soll (im Einklang mit den Ausführungen in Ziff. 1.2 dieser Publikation) neu 65% seines Vermögens in den folgenden Swisscanto-Zielfonds investieren können (vgl. § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages):

- Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF) (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Investment Fund I)

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45 als Dachfonds soll (im Einklang mit den Ausführungen in Ziff. 1.4 dieser Publikation) wie bisher 40% seines Vermögens neu in die folgenden Swisscanto-Zielfonds investieren können (vgl. § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages):

- Swisscanto (CH) IPF I Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I))
- Swisscanto (CH) IPF II Equity Fund Responsible World ex CH (Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund II (IPF II))

### 2.3 Anpassungen bei Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25

Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25 soll der Maximalsatz für Investitionen in Forderungen gegenüber schweizerischen Pfandbriefinstitute (einschliesslich der Derivate) neu höchstens 50% des Vermögens des Teilvermögens betragen (vgl. § 15 Ziff. 3 Bst. b des Fondsvertrages).

Zudem soll das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25 als Dachfonds (im Einklang mit den Ausführungen in Ziff. 1.3 dieser Publikation) neu 50% seines Vermögens in Anteile von aufgeführten Swisscanto-Zielfonds investieren können (vgl. § 15 Ziff. 13 Fondsvertrages).

### 2.4 Anpassungen bei Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75

Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75 soll der Maximalsatz für Investitionen in Forderungen gegenüber schweizerischen Pfandbriefinstitute (einschliesslich der Derivate) neu höchstens 50% des Vermögens des Teilvermögens betragen (vgl. § 15 Ziff. 3 Bst. c 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 Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 24. April 2023

#### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund IV (IPF IV)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

### Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10

(neu: Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 15)

### Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25

### Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45

### Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75

### Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 95

(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.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist die Änderung der Bezeichnung eines Teilvermögens (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Überdies soll die Anlagepolitik bei einem Teilvermögen angepasst werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## 1 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10	Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 15

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 6 Ziff. 4, in der Überschrift von § 8 Ziff. 2A, § 15 Ziff. 3 und 13, § 19 Ziff. 1 und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

## 2 Änderung in der Anlagepolitik des Teilvermögens Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 10

Die Anlagepolitik des oben genannten Teilvermögens erfährt infolge der neuen Bezeichnung Änderungen in den Anlagebestimmungen.

Die Anlagebeschränkungen, die sich auf das Gesamtvermögen des Teilvermögens beziehen, werden in § 8 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages angepasst.

Gemäss der bestehenden Bestimmung in Ziff. 2A Bst. ca von § 8 des Fondsvertrages darf der Anteil in Forderungswertpapiere und -rechte höchstens 95% betragen. Neu beträgt die prozentuale Maximallimite 90%.

Der Höchstanteil der Anlagen in Forderungswertpapiere und -rechte in Schweizer Franken (CHF) wird von 61% auf neu 57% reduziert (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 2A Bst. cb des Fondsvertrages).

Die bisherige Quote für Investitionen in Forderungswertpapiere und -rechte in Fremdwährungen beträgt 34%. Neu soll diese Quote 33% betragen (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 2A Bst. cc des Fondsvertrages).

Bei Anlagen in Beteiligungswertpapiere und -rechte darf der Anteil neu höchstens 25% statt wie bisher 20% betragen (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 2A Bst. cg des Fondsvertrages).

Bei Anlagen in Beteiligungswertpapiere und -rechte von inländischen Gesellschaften wird die prozentuale Maximallimite von 10% auf 15% erhöht (vgl. die Anpassung in § 8 Ziff. 2A Bst. ch 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 auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

Der Fondsvertrag mit Anhang, die Jahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 2. Oktober 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## **Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger**

des

### **Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund IV (IPF IV)**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

### **Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 15**

### **Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25**

### **Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45**

### **Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75**

### **Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 95**

(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 Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 2 A Bst. ba und § 8 Ziff. 2 A Bst. cg, § 8 Ziff. 2 B Bst. ba und § 8 Ziff. 2 B Bst. cg, § 8 Ziff. 2 C Bst. ba und § 8 Ziff. 2 C Bst. cg, § 8 Ziff. 2 D Bst. bb und § 8 Ziff. 2 D Bst. cj sowie § 8 Ziff. 2 E Bst. bb und § 8 Ziff. 2 E Bst. cj des Fondsvertrages angepasst werden.

In den erwähnten Bestimmungen werden bei den zulässigen Anlageinstrumenten neu auch Contingent Convertible Bonds (CoCos) explizit aufgeführt.

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 15 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Notes, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds (CoCos), Forderungswertpapiere aus einer Verbriefung, wie zum Beispiel Schweizer Pfandbriefe, ABS und MBS sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldner, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 A Bst. ba des Fondsvertrages).

Der Anteil der Anlagen in Contingent Convertible Bonds (CoCos) darf dabei 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten (vgl. § 8 Ziff. 2 A Bst. cg des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 25 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Notes, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds (CoCos), Forderungswertpapiere aus einer Verbriefung, wie zum Beispiel Schweizer Pfandbriefe, ABS und MBS sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldner, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 B Bst. ba des Fondsvertrages).

Der Anteil der Anlagen in Contingent Convertible Bonds (CoCos) darf dabei 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten (vgl. § 8 Ziff. 2 B Bst. cg des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 45 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Notes, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds (CoCos), Forderungswertpapiere aus einer Verbriefung, wie zum Beispiel Schweizer Pfandbriefe, ABS und MBS sowie andere fest oder variabel verzinsliche



Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldnern, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 C Bst. ba des Fondsvertrages).

Der Anteil der Anlagen in Contingent Convertible Bonds (CoCos) darf dabei 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten (vgl. § 8 Ziff. 2 C Bst. cg des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 75 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Notes, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds (CoCos), Forderungswertpapiere aus einer Verbriefung, wie zum Beispiel Schweizer Pfandbriefe, ABS und MBS sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldnern, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 D Bst. bb des Fondsvertrages).

Der Anteil der Anlagen in Contingent Convertible Bonds (CoCos) darf dabei 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten (vgl. § 8 Ziff. 2 D Bst. cj des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) IPF IV Responsible Portfolio 95 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen, Notes, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds (CoCos), Forderungswertpapiere aus einer Verbriefung, wie zum Beispiel Schweizer Pfandbriefe, ABS und MBS sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldnern, zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 E Bst. bb des Fondsvertrages).

Der Anteil der Anlagen in Contingent Convertible Bonds (CoCos) darf dabei 10% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten (vgl. § 8 Ziff. 2 E Bst. cj 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 auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

Der Fondsvertrag mit Anhang, die Jahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 18. März 2024

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich