

SWISSCANTO (CH) IPF IV RESPONSIBLE PORTFOLIO 75

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»

Klasse	Valor	Währung
ASTT BVG 3 CHF	115578044	CHF
ASTT BVG CHF	56015461	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter 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	10
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	10
7	Pauschale Verwaltungskommission	10
8	Benchmark	11
9	TER	11
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	22.10.2020
	bis	31.05.2024	31.05.2023	31.05.2022	31.05.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		557'940'433.12	343'476'118.90	234'724'332.45	29'568'451.98
Klasse ASTT BVG 3 CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		417'098'431.79	258'354'072.48	185'668'743.45	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'864'721.621	2'661'357.413	1'872'013.432	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		107.9246	97.0761	99.1813	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		108.0433	97.1925	99.2805	
Thesaurierung je Anteil		1.00	0.66	-	
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.07 %	1.06 %	1.09 %	
Klasse ASTT BVG CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		140'842'001.33	85'122'046.42	49'055'589.00	29'568'451.98
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'111'054.834	749'158.478	424'055.318	253'460.127
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		126.7642	113.6236	115.6821	116.6600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		126.9037	113.7599	115.7977	116.6600
Thesaurierung je Anteil		1.58	1.16	0.95	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.72 %	0.71 %	0.74 %	0.74 %

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 3 CHF (Lancierung 09.03.2022)	11.18 %	8.21 %	-7.88 %	-
Klasse ASTT BVG CHF (Lancierung 22.10.2020)	11.57 %	8.59 %	-14.72 %	17.68 %

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	8'408'950.13	15'447'069.03
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	548'995'173.29	328'113'956.51
Derivative Finanzinstrumente	-216'867.31	-269'540.84
Sonstige Vermögenswerte	1'199'934.37	482'221.47
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	558'387'190.48	343'773'706.17
Andere Verbindlichkeiten	-446'757.36	-297'587.27
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	557'940'433.12	343'476'118.90

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Klasse ASTT BVG 3 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'661'357.413	1'872'013.432
Ausgegebene Anteile		1'251'805.605	817'250.988
Zurückgenommene Anteile		-48'441.397	-27'907.007
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'864'721.621	2'661'357.413

	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Klasse ASTT BVG CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		749'158.478	424'055.318
Ausgegebene Anteile		400'594.976	344'309.292
Zurückgenommene Anteile		-38'698.620	-19'206.132
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'111'054.834	749'158.478

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		343'476'118.90	234'724'332.45
Saldo aus dem Anteilverkehr		163'006'707.65	109'731'425.79
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		51'457'606.57	-979'639.34
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		557'940'433.12	343'476'118.90

Erfolgsrechnung

	von bis	01.06.2023 31.05.2024	01.06.2022 31.05.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		69'841.36	16'956.36
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-0.84	-8'193.69
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		8'079'998.66	4'273'160.68
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'661'374.88	1'024'988.08
Total Ertrag		9'811'214.06	5'306'911.43
Aufwand			
Reglementarische Vergütungen		-4'092'914.36	-2'638'740.08
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-89'618.15	-27'074.03
Total Aufwand		-4'182'532.51	-2'665'814.11
Nettoertrag / Verlust		5'628'681.55	2'641'097.32
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-6'228'305.39	-3'361'222.03
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		202'564.68	131'567.58
Realisierter Erfolg		-397'059.16	-588'557.13
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		51'854'665.73	-391'082.21
Gesamterfolg		51'457'606.57	-979'639.34

Verwendung des Erfolges

	31.05.2024	31.05.2023
Klasse ASTT BVG 3 CHF		
Nettoertrag	3'868'679.42	1'769'578.71
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3'868'679.42	1'769'578.71
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	0.00	619'352.55
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'868'679.42	1'150'226.16
Total	3'868'679.42	1'769'578.71

	31.05.2024	31.05.2023
Klasse ASTT BVG CHF		
Nettoertrag	1'760'002.13	871'518.61
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'760'002.13	871'518.61
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'760'002.13	871'518.61
Total	1'760'002.13	871'518.61

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.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							61'970'826.03	11.10	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							61'970'826.03	11.10	
CH0192252887	SWC AST IMMOBILIEN RESPONSIBLE SCHWEIZ NT CHF	125'471	55'400	0	180'871 CHF	179.78	32'516'988.38	5.82	a)
IE00BL25JP72	X MSCI WORLD MOMENTUM 1C	0	183'313	91'657	91'656 USD	62.53	5'170'446.90	0.93	a)
CH							37'687'435.28	6.75	
IE00BJ5JP105	ISHARES MSCI WD ENERGY-USD D	0	877'818	0	877'818 EUR	6.72	5'778'122.90	1.03	a)
DE							5'778'122.90	1.03	
IE0007UJ6IE0	IVZ US INSURANCE ACC	0	831'122	0	831'122 USD	6.79	5'088'495.39	0.91	a)
IE00BNRQM384	INVECO NASDAQ-100 SWAP ACC	0	283'000	181'576	101'424 USD	56.74	5'191'690.80	0.93	a)
LU1452600270	LYXOR CORE US TIPS DR ETF	0	38'724	38'724	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB							10'280'186.19	1.84	
IE00BD8PH067	ISHARES USD TRES 20+ CHF-H D	1'309'206	0	1'309'206	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
IE00BSKRJZ44	ISHARES USD TRES 20PLUS YR	0	4'614'852	1'924'619	2'690'233 USD	3.39	8'225'081.66	1.47	a)
IE							8'225'081.66	1.47	
IE00BM67HN09	X MSCI WORLD CONSUMER STAPL	0	87'135	87'135	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
US4642874329	ISHARES 20+ YEAR TREASURY BO	0	95'126	95'126	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US							0.00	0.00	
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							487'024'347.26	87.22	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							487'024'347.26	87.22	
CH0117045150	SWC (CH) INDEX BF EMU GOVT. NT EUR	0	69'660	0	69'660 EUR	116.20	7'927'675.12	1.42	a)
CH0117045192	SWC (CH) INDEX BF USA GOVT. NT USD	32'574	43'046	75'620	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0117048352	SWC (CH) INDEX BF WLD EX JPY/CHF INFL.-L. NTH1 CHF	0	37'695	37'695	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0192251772	SWC (CH) EF RESP SMC SWITZERLAND (I) NT CHF	38'802	30'724	23'705	45'822 CHF	233.22	10'686'620.89	1.91	a)
CH0215804375	SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVT. NT	0	126'238	55'505	70'733 AUD	114.64	4'865'226.37	0.87	a)
CH0215804458	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. NT GBP	0	32'952	32'952	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	0	157'961	6'532	151'429 CHF	169.30	25'636'452.59	4.59	a)
CH0224705639	SWC (CH) PBF RESPON DOMESTIC CHF NT CHF	299'962	111'541	77'293	334'210 CHF	94.96	31'736'118.27	5.68	a)
CH0224706454	SWC (CH) PEF RESPONSIBLE SWITZERLAND NT CHF	473'020	204'061	177'862	499'220 CHF	175.92	87'821'063.73	15.73	a)
CH0414225430	SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD	207	91	139	159 USD	210'965.66	30'175'849.16	5.40	a)
CH0414225505	SWC (CH) IPF I EF SYST RESP WORLD ENH ST CHF	372	258	20	610 CHF	151'842.20	92'661'705.05	16.59	a)
CH0461413939	SWC (CH) IEF UNITED KINGDOM NT GBP	24'396	72'731	24'396	72'731 GBP	132.82	11'096'062.17	1.99	a)
CH0527915919	SWC(CH)IPF I INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH ST CHF	0	26	26	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0555645537	SWC (CH) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT CHF	0	178'188	0	178'188 CHF	109.58	19'525'301.72	3.50	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS.GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	294'769	264'258	22'709	536'318 CHF	85.20	45'692'161.32	8.18	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	34'675	127'261	32'735	129'201 CHF	94.82	12'250'338.92	2.19	a)
CH0568203662	SWC (CH) IPF II EF RESPONSIBLE WLD EX CH ST CHF	373	154	55	473 CHF	146'111.80	69'043'229.56	12.36	a)
CH0568203746	SWC (CH) IPF II EF SUSTAINABLE ST CHF	241	142	134	250 CHF	151'914.81	37'906'542.39	6.79	a)
CH							487'024'347.26	87.22	
Derivative Finanzinstrumente							-216'867.31	-0.04	
Optionen und Optionsscheine							0.00	0.00	
DE000C247353	NESE 12/15/23 P120	70	0	70	0 CHF	0.00	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.
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		64'331'340	70'873'300		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		1'162'467	178'280'800		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		1'650'254	253'089'700		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		2'770'837	2'467'100		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		2'569'463	2'287'800		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		20'946'956	21'587'300		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		2'878'071	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 05.07.2023		10'607'000	11'344'462		EUR/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		775'046	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		869'062	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		1'213'648	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		924'514	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 08.08.2023		2'776'400	2'711'532		EUR/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 08.08.2023		21'082'934	21'587'300		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.08.2023		865'935	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.08.2023		2'681'597	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 08.08.2023		5'396'174	4'754'900		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/GBP Verfall 08.08.2023		1'324'372	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 08.08.2023		2'919'626	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.08.2023		914'367	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 08.08.2023		1'197'149	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.08.2023		780'214	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 08.08.2023		10'607'000	11'567'803		EUR/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		63'455'842	70'873'300		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		2'437'707	2'729'700		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.09.2023		64'397'399	73'603'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.09.2023		18'034'330	18'810'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.09.2023		5'284'296	4'754'900		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.09.2023		3'513'157	3'163'200		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 01.09.2023		765'126	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 01.09.2023		857'106	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 01.09.2023		10'607'000	11'628'836		EUR/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.09.2023		2'654'287	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.09.2023		2'827'713	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/GBP Verfall 01.09.2023		1'301'810	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 01.09.2023		1'172'642	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.09.2023		898'797	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.10.2023		8'788'283	7'918'100		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.10.2023		844'228	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		68'938'447	78'603'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.10.2023		2'598'925	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/GBP Verfall 04.10.2023		1'288'498	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 04.10.2023		10'607'000	11'566'955		EUR/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.10.2023		763'086	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.10.2023		2'796'254	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.10.2023		17'981'998	18'810'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		1'171'679	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.10.2023		895'012	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.10.2023		2'358'700	2'636'288		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		71'671'001	78'603'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		2'897'675	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		18'085'589	18'810'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 02.11.2023		10'607'000	11'185'495		EUR/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		2'638'896	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		6'161'850	5'559'400		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		868'571	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		766'940	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/GBP Verfall 02.11.2023		1'326'910	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		1'219'490	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		917'835	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		2'719'724	3'025'200		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.12.2023		73'411'669	81'628'200		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.12.2023		6'098'339	5'559'400		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/EUR Verfall 01.12.2023		10'607'000	11'324'426		EUR/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.12.2023		18'069'356	18'810'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 01.12.2023		2'814'694	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 01.12.2023		909'594	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 01.12.2023		849'030	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.12.2023		2'587'826	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 01.12.2023		1'204'917	10'468'800		CHF/HKD	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.
AUD/GBP	Verfall 01.12.2023		1'317'327	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 01.12.2023		765'340	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2024		71'251'786	81'628'200		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2024		2'490'158	2'852'800		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.01.2024		443'100	491'237		GBP/CHF	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.01.2024		10'607'000	11'671'137		EUR/USD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.01.2024		6'163'351	5'559'400		CHF/GBP	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.01.2024		18'071'669	18'810'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2024		2'571'663	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.01.2024		2'784'013	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.01.2024		766'756	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
AUD/GBP	Verfall 05.01.2024		1'317'860	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.01.2024		885'026	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.01.2024		906'296	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.01.2024		1'172'129	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2024		12'097'212	13'936'800		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		83'561'338	98'417'800		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		3'318'840	3'908'900		CHF/USD	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.02.2024		883'719	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2024		869'251	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2024		741'831	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'139'456	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		2'755'101	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.02.2024		10'607'000	11'613'297		EUR/USD	0.00	0.00	
AUD/GBP	Verfall 02.02.2024		1'347'701	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024		5'485'502	5'116'300		CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2024		2'578'612	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		17'484'167	18'810'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 02.02.2024		3'682'400	3'422'680		EUR/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		87'971'185	102'326'700		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		10'718'852	12'468'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		14'098'007	15'128'500		CHF/EUR	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.03.2024		8'854'669	9'501'900		CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.03.2024		2'522'620	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.03.2024		2'771'851	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.03.2024		743'799	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.03.2024		886'188	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.03.2024		10'607'000	11'495'474		EUR/USD	0.00	0.00	
AUD/GBP	Verfall 04.03.2024		1'310'237	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.03.2024		5'575'074	5'116'300		CHF/GBP	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'152'364	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.03.2024		864'794	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.03.2024		3'815'800	3'331'392		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		4'319'348	4'902'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.04.2024		23'413'141	24'630'400		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.04.2024		5'671'961	5'116'300		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.04.2024		10'607'000	11'518'216		EUR/USD	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.04.2024		758'911	5'947'300		CHF/DKK	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		101'421'629	115'880'900		CHF/USD	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.04.2024		899'181	1'379'100		CHF/SGD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.04.2024		2'532'537	431'370'500		CHF/JPY	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.04.2024		887'024	10'460'800		CHF/SEK	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.04.2024		2'787'796	4'323'700		CHF/CAD	0.00	0.00	
AUD/GBP	Verfall 04.04.2024		1'295'366	2'519'800		GBP/AUD	0.00	0.00	
USD/JPY	Verfall 04.04.2024		431'370'500	2'928'268		JPY/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.04.2024		6'000'848	1'009'625'100		CHF/JPY	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.04.2024		1'171'731	10'468'800		CHF/HKD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		23'888'163	24'630'400		CHF/EUR	-182'573.73	-0.03	b)
JPY/CHF	Verfall 02.07.2024		8'656'853	1'440'995'600		CHF/JPY	373'811.71	0.07	b)
GBP/CHF	Verfall 02.07.2024		5'780'181	5'116'300		CHF/GBP	-76'494.58	-0.01	b)
CAD/CHF	Verfall 02.07.2024		2'867'824	4'323'700		CHF/CAD	14'738.81	0.00	b)
DKK/CHF	Verfall 02.07.2024		774'017	5'947'300		CHF/DKK	-5'466.95	0.00	b)
SGD/CHF	Verfall 02.07.2024		920'347	1'379'100		CHF/SGD	1'858.62	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 02.07.2024		877'494	10'460'800		CHF/SEK	-18'007.54	0.00	b)
HKD/CHF	Verfall 02.07.2024		1'205'503	10'468'800		CHF/HKD	1'559.30	0.00	b)
AUD/GBP	Verfall 02.07.2024		1'306'292	2'519'800		GBP/AUD	-12'476.73	0.00	b)
USD/EUR	Verfall 02.07.2024		10'607'000	11'442'132		EUR/USD	79'726.22	0.01	b)
USD/JPY	Verfall 02.07.2024		431'370'500	2'881'930		JPY/USD	-111'223.38	-0.02	b)
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		104'149'465	115'880'900		CHF/USD	-25'196.89	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		5'154'023	5'760'700		CHF/USD	-24'705.95	0.00	b)
GBP/USD	Verfall 02.07.2024		10'913'071	8'741'100		USD/GBP	-195'301.91	-0.03	b)
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		9'135'754	10'138'300		CHF/USD	21'592.88	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 02.07.2024		11'495'972	11'823'300		CHF/EUR	-58'707.19	-0.01	b)
Devisentermingeschäfte							-216'867.31	-0.04	

Vermögensaufstellung		Kurswert CHF	in %)
Bankguthaben auf Sicht		8'408'950.13	1.51
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		548'995'173.29	98.32
Derivative Finanzinstrumente		-216'867.31	-0.04
Sonstige Vermögenswerte		1'199'934.37	0.21
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		558'387'190.48	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-446'757.36	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		557'940'433.12	

Bewertungskategorien		Kurswert CHF	in %)
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);	548'995'173.29	98.32
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-216'867.31	-0.04
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

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	24'210'319.27	4.339
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	199'878'073.98	35.824

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.06.2023 - 31.05.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
ASTT BVG 3 CHF	CHF	-	-	-	-
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	Max
ASTT BVG CHF	0.700	1.200	0.600	0.100		5.000
ASTT BVG 3 CHF	1.050	1.300	0.900	0.150		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	1.584	-	1.584
ASTT BVG 3 CHF 34)	Nein	CHF	1.001	-	1.001

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^{bis} 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^{bis} 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 Schuldern, 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 Schuldern, 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 Schuldern, 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^{bis} 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