

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND SWITZERLAND TOTAL (II)

Jahresbericht per 30.09.2023

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

Klasse	Valor	Währung
ASTT CHF	35933946	CHF
DA CHF	2541750	CHF
DT CHF	35751889	CHF
FA CHF	2541749	CHF
GT CHF	19230647	CHF
NT CHF	19230646	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. Januar 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund III,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (II)
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund EMU
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund United Kingdom
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund MSCI® World ex Switzerland

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

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

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Pauschale Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	16
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	16
12	Fussnoten	16
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'555'167'243.45	3'015'659'649.54	3'771'745'267.02	3'297'732'960.45
Klasse ASTT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'037'408'599.74	961'555'400.23	1'138'941'571.47	1'012'571'434.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'570'991.914	7'647'020.996	7'915'583.363	8'307'250.650
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		137.0241	125.7425	143.8860	121.8901
Thesaurierung je Anteil		3.67	3.34	3.09	2.88
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse DA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		41'363'266.46	59'399'398.64	81'778'456.55	71'058'678.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		249'027.358	380'273.358	448'109.458	449'741.758
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		166.0993	156.2018	182.4966	157.9988
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		171.4937	161.9976	168.8023	146.6522
Ausschüttung je Anteil		4.45	4.20	4.00	3.60
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse DT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		16'384'623.32	10'510'993.86	13'032'114.00	13'800'429.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		123'072.115	85'316.826	91'788.228	113'842.094
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		133.1303	123.1995	141.9802	121.2243
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		137.4539	127.7708	131.3262	112.5186
Thesaurierung je Anteil		3.56	3.27	3.05	2.86
Total Expense Ratio (TER)		0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.16 %
Klasse FA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		195'046'523.43	189'608'045.95	225'487'317.58	216'048'583.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'175'719.792	1'214'613.776	1'237'224.365	1'368'794.645
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		165.8954	156.1056	182.2526	157.8386
Ausschüttung je Anteil		4.40	4.25	3.80	3.60
Total Expense Ratio (TER)		0.19 %	0.19 %	0.19 %	0.19 %
Klasse GT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		262'292'030.18	258'998'205.95	358'297'070.20	705'706'208.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'378'502.791	1'471'101.449	1'766'161.986	4'074'821.880
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		190.2731	176.0573	202.8676	173.1870
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		196.4526	182.5898	187.6447	160.7496
Thesaurierung je Anteil		5.13	4.71	4.40	4.13
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'002'672'200.32	1'535'587'604.91	1'954'208'737.22	1'278'547'626.75
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		10'296'030.541	8'539'792.112	9'440'751.683	7'242'056.326
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		194.5092	179.8156	206.9972	176.5448
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		200.8262	186.4875	191.4643	163.8663
Thesaurierung je Anteil		5.52	5.10	4.76	4.45
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse ASTT CHF	8.97 %	-16.57 %	23.15 %	3.66 %
Klasse DA CHF	8.98 %	-16.56 %	23.15 %	3.65 %
Klasse DT CHF	8.98 %	-16.57 %	23.15 %	3.66 %
Klasse FA CHF	8.95 %	-16.58 %	23.11 %	3.62 %
Klasse GT CHF	9.00 %	-16.55 %	23.18 %	3.68 %
Klasse NT CHF	9.15 %	-16.43 %	23.35 %	3.83 %
Benchmark	9.13 %	-16.48 %	23.38 %	3.82 %
Tracking Error 33)	0.02 %	0.03 %	0.02 %	0.05 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse ASTT CHF	-0.16 %
Klasse DA CHF	-0.15 %
Klasse DT CHF	-0.15 %
Klasse FA CHF	-0.18 %
Klasse GT CHF	-0.13 %
Klasse NT CHF	0.02 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	8'264'682.12	9'235'529.14
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	3'523'997'757.23	2'986'155'377.95
Bezugsrechte	47'198.48	93.99
Sonstige Vermögenswerte	23'053'803.66	20'469'594.89
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'555'363'441.49	3'015'860'595.97
Andere Verbindlichkeiten	-196'198.04	-200'946.43
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	3'555'167'243.45	3'015'659'649.54

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Klasse ASTT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'647'020.996	7'915'583.363
Ausgegebene Anteile		271'791.924	112'690.754
Zurückgenommene Anteile		-347'821.006	-381'253.121
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'570'991.914	7'647'020.996
Klasse DA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		380'273.358	448'109.458
Ausgegebene Anteile		12'343.000	16'504.000
Zurückgenommene Anteile		-143'589.000	-84'340.100
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		249'027.358	380'273.358
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		85'316.826	91'788.228
Ausgegebene Anteile		47'938.895	5'980.714
Zurückgenommene Anteile		-10'183.606	-12'452.116
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		123'072.115	85'316.826
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'214'613.776	1'237'224.365
Ausgegebene Anteile		75'475.168	103'316.972
Zurückgenommene Anteile		-114'369.152	-125'927.561
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'175'719.792	1'214'613.776
Klasse GT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'471'101.449	1'766'161.986
Ausgegebene Anteile		181'462.594	385'285.837
Zurückgenommene Anteile		-274'061.252	-680'346.374
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'378'502.791	1'471'101.449
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'539'792.112	9'440'751.683
Ausgegebene Anteile		2'499'001.975	1'044'379.349
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		594'373.246	-
Zurückgenommene Anteile		-1'337'136.792	-1'945'338.920
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		10'296'030.541	8'539'792.112

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	12.07.2023	117'255'517.04	594'373.246

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		3'015'659'649.54	3'771'745'267.02
Ausbezahlte Ausschüttung		-6'636'205.92	-6'419'710.68
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-19'447'364.45	-17'189'601.03
Saldo aus dem Anteilverkehr		285'977'030.93	-317'973'515.48
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		279'614'133.35	-414'502'790.29
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'555'167'243.45	3'015'659'649.54

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		11'245.86	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-56'337.44
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		97'384'161.04	85'709'218.91
Erträge der Gratisaktien		9'126.25	1'765.43
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		10'594'129.55	3'331'104.35
Total Ertrag		107'998'662.70	88'985'751.25
Aufwand			
Passivzinsen		-3.00	-914.30
Reglementarische Vergütungen		-2'530'776.99	-2'776'747.08
Sonstige Aufwendungen		-1.20	-365.75
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-6'988'015.25	-3'335'114.40
Total Aufwand		-9'518'796.44	-6'113'141.53
Nettoertrag / Verlust		98'479'866.26	82'872'609.72
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		42'446'797.12	126'311'453.68
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		7'526'468.56	7'950'851.11
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		163'834.84	153'963.79
Realisierter Erfolg		148'616'966.78	217'288'878.30
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		130'997'166.57	-631'791'668.59
Gesamterfolg		279'614'133.35	-414'502'790.29

Verwendung des Erfolges

Klasse ASTT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	27'816'310.82	25'545'415.84
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	27'816'310.82	25'545'415.84
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	27'816'310.82	25'545'415.84
Total	27'816'310.82	25'545'415.84
Klasse DA CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	1'103'602.64	1'571'279.59
Vortrag des Vorjahres	14'740.91	40'609.42
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'118'343.55	1'611'889.01
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	1'108'171.74	1'597'148.10
Vortrag auf neue Rechnung	10'171.81	14'740.91
Total	1'118'343.55	1'611'889.01
Klasse DT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	439'272.06	279'205.69
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	439'272.06	279'205.69
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	153'745.22	97'721.99
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	285'526.84	181'483.70
Total	439'272.06	279'205.69
Klasse FA CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	5'169'321.98	4'966'929.09
Vortrag des Vorjahres	9'487.06	204'666.52
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5'178'809.04	5'171'595.61
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	5'173'167.09	5'162'108.55
Vortrag auf neue Rechnung	5'641.95	9'487.06
Total	5'178'809.04	5'171'595.61
Klasse GT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	7'084'073.17	6'938'493.76
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	7'084'073.17	6'938'493.76
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	2'479'425.61	2'428'472.82
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'604'647.56	4'510'020.94
Total	7'084'073.17	6'938'493.76
Klasse NT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	56'867'285.59	43'571'285.75
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	56'867'285.59	43'571'285.75
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	19'903'549.96	15'249'950.01
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	36'963'735.63	28'321'335.74
Total	56'867'285.59	43'571'285.75

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							3'524'044'955.71	99.12	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							3'523'997'757.23	99.12	
CH0001624714	CPH CHEMIE & PAPIER HLDG-REG	2'680	0	0	2'680 CHF	85.00	227'800.00	0.01	a)
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	1'634'410	0	0	1'634'410 CHF	0.11	176'516.28	0.00	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	16'879	3'546	1'278	19'147 CHF	2'994.00	57'326'118.00	1.61	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	478'166	88'566	16'864	549'868 CHF	14.50	7'973'086.00	0.22	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	1'194'663	231'012	148'718	1'276'957 CHF	58.78	75'059'532.46	2.11	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	14'080	3'625	1'677	16'028 CHF	623.00	9'985'444.00	0.28	a)
CH0021218067	EVOLVA HOLDING SA	2'051'240	0	2'051'240	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0418792922	SIKA AG-REG	325'277	67'313	23'156	369'434 CHF	233.10	86'115'065.40	2.42	a)
CH0435377954	SIG GROUP AG	736'871	143'177	42'175	837'873 CHF	22.64	18'969'444.72	0.53	a)
CH0453226893	ALUFLEXPACK AG	18'912	0	0	18'912 CHF	12.00	226'944.00	0.01	a)
CH0460027110	BLACKSTONE RESOURCES AG	28'888	0	28'888	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	27'224	4'638	0	31'862 CHF	40.45	1'288'817.90	0.04	a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	6'226	1'390	0	7'616 CHF	215.00	1'637'440.00	0.05	a)
CH1173567111	GURIT HOLDING AG-BR	7'678	833	0	8'511 CHF	92.90	790'671.90	0.02	a)
CH1262055788	EVOLVA HOLDING SA	0	8'204	0	8'204 CHF	2.74	22'478.96	0.00	a)
Materials							259'799'359.62	7.31	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	404'314	136'519	55'890	484'943 CHF	3.89	1'887'398.16	0.05	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	123'625	27'564	7'038	144'151 CHF	35.76	5'154'839.76	0.14	a)
CH0002187810	PHOENIX MECANO AG-BR	1'805	0	1'805	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002361068	STARRAG GROUP HOLDING AG	1'099	0	0	1'099 CHF	52.00	57'148.00	0.00	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	14'032	2'800	989	15'843 CHF	350.60	5'554'555.80	0.16	a)
CH0002497458	SGS SA-REG	12'796	1'282	14'078	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0003245351	VON ROLL HOLDING AG-BR	168'536	0	0	168'536 CHF	0.86	145'278.03	0.00	a)
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	10'535	0	0	10'535 CHF	13.20	139'062.00	0.00	a)
CH0003420806	ORELL FUESSLI HOLDING AG-REG	1'725	0	0	1'725 CHF	72.20	124'545.00	0.00	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	2'261	640	136	2'765 CHF	1'118.00	3'091'270.00	0.09	a)
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	5'427	2'251	0	7'678 CHF	85.20	654'165.60	0.02	a)
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	1'457	318	34	1'741 CHF	2'510.00	4'369'910.00	0.12	a)
CH0008207356	BVZ HOLDING AG-REG NEW	124	0	0	124 CHF	900.00	111'600.00	0.00	a)
CH0008967926	ADVAL TECH HOLDING AG-REG	364	0	0	364 CHF	110.00	40'040.00	0.00	a)
CH0009320091	FEINTOOL INTL HOLDING-REG	18'177	0	0	18'177 CHF	21.10	383'534.70	0.01	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	8'239	1'976	410	9'805 CHF	211.00	2'068'855.00	0.06	a)
CH0010754924	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG-BR	2'142	275	2'417	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011003594	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-BR	1'291	0	1'291	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0011607683	TORNOS HOLDING AG - REG	15'941	0	0	15'941 CHF	6.06	96'602.46	0.00	a)
CH0011795959	DORMAKABA HOLDING AG	6'365	1'976	579	7'762 CHF	451.00	3'500'662.00	0.10	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	354'926	83'318	36'386	401'858 CHF	37.76	15'174'158.08	0.43	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	3'440'594	888'755	442'189	3'887'160 CHF	32.80	127'498'848.00	3.59	a)
CH0017875789	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG	11'644	0	0	11'644 CHF	158.60	1'846'738.40	0.05	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	29'961	13'014	3'538	39'437 CHF	30.05	1'185'081.85	0.03	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	85'273	25'452	12'075	98'650 CHF	183.00	18'052'950.00	0.51	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	43'980	8'784	2'652	50'112 CHF	176.80	8'859'801.60	0.25	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	120'438	22'599	9'577	133'460 CHF	261.00	34'833'060.00	0.98	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	6'562	2'015	1'374	7'203 CHF	499.50	3'597'898.50	0.10	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	75'698	18'199	10'129	83'768 CHF	459.00	38'449'512.00	1.08	a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	37'162	10'803	2'591	45'374 CHF	66.20	3'003'758.80	0.08	a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	15'270	3'782	1'122	17'930 CHF	175.60	3'148'508.00	0.09	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	37'450	7'129	893	43'686 CHF	87.65	3'829'077.90	0.11	a)
CH0100837282	KARDEX HOLDING AG-REG	12'660	2'355	360	14'655 CHF	200.50	2'938'327.50	0.08	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	132'976	12'900	0	145'876 CHF	8.39	1'223'899.64	0.03	a)
CH0110303119	LECLANCHE SA-REG	165'975	0	0	165'975 CHF	0.55	90'622.35	0.00	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	76'378	27'983	12'086	92'275 CHF	62.05	5'725'663.75	0.16	a)
CH0208062627	MEIER TOBLER GROUP AG	23'692	0	5'884	17'808 CHF	40.25	716'772.00	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0212255803	BURKHALTER HOLDING AG	16'623	1'159	0	17'782	CHF 87.70	1'559'481.40	0.04	a)
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	11'740	2'907	364	14'283	CHF 201.00	2'870'883.00	0.08	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	43'080	7'113	5'014	45'179	CHF 100.20	4'526'935.80	0.13	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	3'213	283	95	3'401	CHF 569.00	1'935'169.00	0.05	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-REG	21'517	9'185	2'627	28'075	CHF 53.80	1'510'435.00	0.04	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	56'410	12'222	4'652	63'980	CHF 329.00	21'049'420.00	0.59	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	39'587	10'196	3'278	46'505	CHF 174.80	8'129'074.00	0.23	a)
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	8'497	0	0	8'497	CHF 18.05	153'370.85	0.00	a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	20'956	4'209	1'520	23'645	CHF 435.80	10'304'491.00	0.29	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	56'803	10'732	0	67'535	CHF 11.26	760'444.10	0.02	a)
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	167'813	36'205	9'771	194'247	CHF 51.65	10'032'857.55	0.28	a)
CH1169360919	ACCELERON INDUSTRIES AG	0	251'437	20'203	231'234	CHF 23.82	5'507'993.88	0.15	a)
CH1209713275	BOBST GROUP SA-LINE 2	17'043	0	17'043	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH1248667003	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG	0	2'730	119	2'611	CHF 585.00	1'527'435.00	0.04	a)
CH1256740924	SGS SA-REG	0	378'885	14'264	364'621	CHF 77.02	28'083'109.42	0.79	a)
CH1261338102	PHOENIX MECANO AG - REG	0	1'805	0	1'805	CHF 360.00	649'800.00	0.02	a)
CH1278877563	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-REG	0	1'291	0	1'291	CHF 338.00	436'358.00	0.01	a)
Industrials							396'591'402.88	11.15	
AT0000KTMIO2	PIERER MOBILITY AG	20'555	2'642	1'200	21'997	CHF 62.40	1'372'612.80	0.04	a)
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	117'600	28'952	14'230	132'322	CHF 44.85	5'934'641.70	0.17	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	61'321	13'168	4'909	69'580	CHF 235.40	16'379'132.00	0.46	a)
CH0023405456	DUFREY AG-REG	138'887	127'500	11'097	255'290	CHF 34.91	8'912'173.90	0.25	a)
CH0038285679	ORASCOM DEVELOPMENT HOLDING	28'173	0	0	28'173	CHF 5.70	160'586.10	0.00	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	13'882	0	0	13'882	CHF 30.25	419'930.50	0.01	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	6'546	2'588	0	9'134	CHF 119.20	1'088'772.80	0.03	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1'106'200	231'297	82'405	1'255'092	CHF 112.00	140'570'304.00	3.95	a)
CH0276837694	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	103'649	37'020	31'655	109'014	CHF 13.68	1'491'311.52	0.04	a)
CH0527044959	BERGBAHNEN ENGELB. TRUEB-REG	3'275	0	0	3'275	CHF 44.80	146'720.00	0.00	a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	6'660	0	109	6'551	CHF 63.20	414'023.20	0.01	a)
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	11'899	0	0	11'899	CHF 23.45	279'031.55	0.01	a)
Consumer Discretionary							177'169'240.07	4.98	
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	7'583	1'794	726	8'651	CHF 1'458.00	12'613'158.00	0.35	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	226	51	14	263	CHF 100'400.00	26'405'200.00	0.74	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2'235	549	395	2'389	CHF 10'190.00	24'343'910.00	0.68	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	4'610	1'519	614	5'515	CHF 864.00	4'764'960.00	0.13	a)
CH0012949464	GROUPE MINOTERIES SA-REG	261	0	0	261	CHF 288.00	75'168.00	0.00	a)
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	2'860	0	0	2'860	CHF 22.60	64'636.00	0.00	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	5'836'188	1'192'942	596'280	6'432'850	CHF 103.74	667'343'859.00	18.77	a)
CH0042615283	DOCMORRIS AG	26'477	16'563	10'055	32'985	CHF 50.80	1'675'638.00	0.05	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	2'118'084	438'849	110'817	2'446'116	CHF 1.57	3'835'509.89	0.11	a)
CH0111677362	ORIOR AG	15'954	0	691	15'263	CHF 72.90	1'112'672.70	0.03	a)
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	4'985	506	191	5'300	CHF 273.00	1'446'900.00	0.04	a)
Consumer Staples							743'681'611.59	20.92	
CH0011339204	ASCOM HOLDING AG-REG	84'640	16'036	0	100'676	CHF 10.40	1'047'030.40	0.03	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	27'875	11'346	3'665	35'556	CHF 41.00	1'457'796.00	0.04	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	4'846'692	930'924	681'586	5'096'030	CHF 93.87	478'364'336.10	13.45	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1'490'616	320'953	120'004	1'691'565	CHF 250.45	423'652'454.25	11.92	a)
CH0012032113	ROCHE HOLDING AG-BR	57'241	18'742	4'314	71'669	CHF 269.40	19'307'628.60	0.54	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	27'324	5'928	2'337	30'915	CHF 309.20	9'558'918.00	0.27	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	101'149	29'464	8'829	121'784	CHF 217.70	26'512'376.80	0.75	a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	17'781	12'694	0	30'475	CHF 77.80	2'370'955.00	0.07	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	157'948	33'654	12'704	178'898	CHF 425.60	76'138'988.80	2.14	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	9'064	1'260	384	9'940	CHF 784.50	7'797'930.00	0.22	a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	11'571	3'354	1'519	13'406	CHF 269.50	3'612'917.00	0.10	a)
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	9'844	0	0	9'844	CHF 66.50	654'626.00	0.02	a)
CH0027148649	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	58'581	0	58'581	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0029850754	ADDEX THERAPEUTICS LTD	14'290	0	0	14'290	CHF 0.07	940.28	0.00	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	117'101	28'048	0	145'149	CHF 41.35	6'001'911.15	0.17	a)
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	449	0	33	416	CHF 1'430.00	594'880.00	0.02	a)
CH0100191136	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	4'488'024	0	4'488'024	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0106213793	SPEXIS AG	19'847	0	0	19'847	CHF 0.29	5'755.63	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0187624256	IVF HARTMANN HOLDING AG-REG	850	0	0	850 CHF	115.00	97'750.00	0.00	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	60'771	0	0	60'771 CHF	3.86	234'272.21	0.01	a)
CH0325814116	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	25'531	0	0	25'531 CHF	2.11	53'870.41	0.00	a)
CH0346177709	OBSEVA SA	148'021	0	148'021	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0360674466	GALENICA AG	107'730	35'703	17'797	125'636 CHF	67.75	8'511'839.00	0.24	a)
CH0363463438	IDORSIA LTD	243'702	69'444	4'364	308'782 CHF	2.59	799'745.38	0.02	a)
CH0386200239	MEDARTIS HOLDING AG	8'887	0	0	8'887 CHF	84.10	747'396.70	0.02	a)
CH0432492467	ALCON INC	1'061'303	218'801	73'748	1'206'356 CHF	70.94	85'578'894.64	2.41	a)
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	13'320	3'639	580	16'379 CHF	115.80	1'896'688.20	0.05	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	32'131	10'273	2'550	39'854 CHF	16.72	666'358.88	0.02	a)
CH1129677105	MEDMIX AG	53'571	15'431	4'000	65'002 CHF	23.25	1'511'296.50	0.04	a)
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	238'906	52'466	20'595	270'777 CHF	117.20	31'735'064.40	0.89	a)
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	66'498	14'243	2'845	77'896 CHF	68.00	5'296'928.00	0.15	a)
CH1251125998	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	0	11'220	0	11'220 CHF	2.30	25'749.90	0.00	a)
CH1260041939	OBSEVA SA	0	148'021	0	148'021 CHF	0.06	8'881.26	0.00	a)
CH1276028821	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	0	5'858	0	5'858 CHF	8.34	48'855.72	0.00	a)
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	41'157	3'121	0	44'278 CHF	5.46	241'757.88	0.01	a)
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	21'345	2'768	0	24'113 CHF	39.90	962'108.70	0.03	a)
Health Care							1'195'496'901.79	33.63	
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	181	0	0	181 CHF	4'650.00	841'650.00	0.02	a)
CH0001340204	GRAUBUENDNER KANTONALBANK-PC	1'643	0	0	1'643 CHF	1'710.00	2'809'530.00	0.08	a)
CH0001341608	HYPOTHEKARBANK LENZBURG-REG	143	0	0	143 CHF	4'160.00	594'880.00	0.02	a)
CH0001473559	BASELLANDS KANTONALBANK-CERT	1'462	0	0	1'462 CHF	886.00	1'295'332.00	0.04	a)
CH0009236461	BASLER KANTONALBK - PC	13'825	0	0	13'825 CHF	65.40	904'155.00	0.03	a)
CH0009691608	BERNER KANTONALBANK AG-REG	10'710	0	0	10'710 CHF	241.00	2'581'110.00	0.07	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	22'880	7'720	4'120	26'480 CHF	167.60	4'438'048.00	0.12	a)
CH0010947627	AIREISIS-REG	30'036	0	0	30'036 CHF	0.67	20'124.12	0.00	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	319'003	66'924	32'913	353'014 CHF	420.10	148'301'181.40	4.17	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	6'755	412	0	7'167 CHF	499.50	3'579'916.50	0.10	a)
CH0011693600	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	7'626	0	7'626	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5'323'377	3'068'803	8'392'180	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	60'772	18'405	8'570	70'607 CHF	54.60	3'855'142.20	0.11	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	96'661	24'292	9'029	111'924 CHF	132.90	14'874'699.60	0.42	a)
CH0014345117	COMPAGNIE FINANCIERE TRAD-BR	3'363	33	0	3'396 CHF	116.50	395'634.00	0.01	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	34'852	5'939	1'000	39'791 CHF	94.90	3'776'165.90	0.11	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	65'701	14'030	8'826	70'905 CHF	571.60	40'529'298.00	1.14	a)
CH0021545667	VAUDOISE ASSURANCES HOL	2'825	0	0	2'825 CHF	441.00	1'245'825.00	0.04	a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	218'635	115'716	12'751	321'600 CHF	10.40	3'344'640.00	0.09	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	47'696	10'502	3'936	54'262 CHF	1'034.50	56'134'039.00	1.58	a)
CH0028422100	BELLEVUE GROUP AG	21'189	0	0	21'189 CHF	20.70	438'612.30	0.01	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	458'146	87'093	52'055	493'184 CHF	58.86	29'028'810.24	0.82	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	330'646	0	330'646	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0126881561	SWISS RE AG	612'153	135'561	49'211	698'503 CHF	94.32	65'882'802.96	1.85	a)
CH0189396655	GLARNER KANTONALBANK	7'115	0	0	7'115 CHF	23.80	169'337.00	0.00	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	26'680	13'730	5'055	35'355 CHF	38.30	1'354'096.50	0.04	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	63'916	22'882	9'082	77'716 CHF	62.30	4'841'706.80	0.14	a)
CH0231351104	THURGAUER KANTONALBANK-CERT	6'579	0	0	6'579 CHF	122.50	805'927.50	0.02	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	6'902'108	1'724'739	1'260'178	7'366'669 CHF	22.69	167'149'719.61	4.70	a)
CH0305951201	WALLISER KANTONALBANK-REG	10'155	0	0	10'155 CHF	114.00	1'157'670.00	0.03	a)
CH0350494719	BANQUE CANTONALE DE GENEV-BR	2'730	0	0	2'730 CHF	217.00	592'410.00	0.02	a)
CH0350665672	BANQUE CANTONALE DU JURA-REG	867	0	0	867 CHF	51.50	44'650.50	0.00	a)
CH0367427686	VALARTIS GROUP AG-BR	2'282	0	2'282	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	74'709	21'085	8'011	87'783 CHF	128.40	11'271'337.20	0.32	a)
CH0493891243	ZUGER KANTONALBANK-BR	344	0	0	344 CHF	7'760.00	2'669'440.00	0.08	a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	34'564	3'421	0	37'985 CHF	95.50	3'627'567.50	0.10	a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	60'592	23'697	9'170	75'119 CHF	96.05	7'215'179.95	0.20	a)
CH1252930610	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	0	50'258	0	50'258 CHF	74.60	3'749'246.80	0.11	a)
CH1289177243	GAM HOLDING AG/NAMEN-AKT 4 LINIE SEPTEMBER 2023	0	330'646	0	330'646 CHF	0.45	149'617.32	0.00	a)
LI0315487269	VP BANK AG-A	9'130	0	0	9'130 CHF	88.00	803'440.00	0.02	a)
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	27'791	0	0	27'791 CHF	65.50	1'820'310.50	0.05	a)
Financials							592'293'253.40	16.66	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
AT0000A18XM4	AMS-OSRAM AG	574'787	114'559	42'822	646'524	CHF 4.32	2'790'397.58	0.08	a)
CH0005319162	ELMA ELECTRONIC AG-REG	117	0	0	117	CHF 1'010.00	118'170.00	0.00	a)
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	4'269	0	0	4'269	CHF 45.00	192'105.00	0.01	a)
CH0009062099	SCHAFFNER HOLDING AG-REG	829	0	0	829	CHF 494.00	409'526.00	0.01	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	3'768	797	336	4'229	CHF 1'118.00	4'728'022.00	0.13	a)
CH0011115703	CREALOGIX HOLDING AG-REG	1'365	0	0	1'365	CHF 52.00	70'980.00	0.00	a)
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	110'677	0	0	110'677	CHF 1.60	177'083.20	0.00	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	141'983	32'853	14'464	160'372	CHF 64.42	10'331'164.24	0.29	a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	1'189	195	0	1'384	CHF 2'045.00	2'830'280.00	0.08	a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	12'991	3'862	1'404	15'449	CHF 230.50	3'560'994.50	0.10	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	359'395	61'722	27'434	393'683	CHF 63.28	24'912'260.24	0.70	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	15'760	6'880	3'439	19'201	CHF 77.90	1'495'757.90	0.04	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	5'168'406	3'130'976	224'712	8'074'670	CHF 0.37	2'995'702.57	0.08	a)
CH0314029270	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	136'698	0	136'698	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	16'508	2'123	341	18'290	CHF 204.40	3'738'476.00	0.11	a)
CH0371153492	LANDIS+GYR GROUP AG	45'142	9'441	2'207	52'376	CHF 66.30	3'472'528.80	0.10	a)
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	22'916	4'178	981	26'113	CHF 73.40	1'916'694.20	0.05	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	238'710	58'371	22'631	274'450	CHF 18.15	4'981'267.50	0.14	a)
CH1276062754	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	0	2'733	0	2'733	CHF 3.75	10'248.75	0.00	a)
VGG794831062	SEALSQ CORP	0	1'408	0	1'408	USD 2.01	2'588.96	0.00	a)
Information Technology							68'734'247.44	1.93	
CH0025607331	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	488	0	488	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0130293662	BKW AG	43'100	11'133	4'255	49'978	CHF 161.50	8'071'447.00	0.23	a)
CH1263676327	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	0	12'200	0	12'200	CHF 56.00	683'200.00	0.02	a)
Utilities							8'754'647.00	0.25	
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	468	0	0	468	CHF 1'930.00	903'240.00	0.03	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	161'644	36'943	14'451	184'136	CHF 83.95	15'458'217.20	0.43	a)
CH0008837566	ALLREAL HOLDING AG-REG	32'692	9'821	3'819	38'694	CHF 146.00	5'649'324.00	0.16	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	16'332	3'253	641	18'944	CHF 245.50	4'650'752.00	0.13	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	97'224	23'719	10'552	110'391	CHF 108.20	11'944'306.20	0.34	a)
CH0032816131	SF URBAN PROPERTIES AG	3'347	0	0	3'347	CHF 89.00	297'883.00	0.01	a)
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	5'025	0	0	5'025	CHF 16.70	83'917.50	0.00	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	38'053	3'654	0	41'707	CHF 13.32	555'537.24	0.02	a)
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	806	0	0	806	CHF 1'595.00	1'285'570.00	0.04	a)
CH0239518779	HIAG IMMOBILIEN AG	12'000	0	361	11'639	CHF 79.00	919'481.00	0.03	a)
CH0273774791	INTERSHOP HOLDING AG	2'745	253	67	2'931	CHF 606.00	1'776'186.00	0.05	a)
CH0284142913	PLAZZA AG-REG A	3'206	0	0	3'206	CHF 299.00	958'594.00	0.03	a)
CH0305285295	VARIA US PROPERTIES AG	4'150	0	0	4'150	CHF 37.30	154'795.00	0.00	a)
CH0312309682	ZUEBLIN IMMOBILIEN HOLDI-REG	5'060	0	0	5'060	CHF 26.60	134'596.00	0.00	a)
CH0325094297	INVESTIS HOLDING SA	9'096	0	0	9'096	CHF 93.00	845'928.00	0.02	a)
CH0516131684	EPIC SUISSE AG	2'161	7'200	0	9'361	CHF 63.20	591'615.20	0.02	a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	16'119	0	0	16'119	CHF 17.00	274'023.00	0.01	a)
Real Estate							46'483'965.34	1.31	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	54'120	12'141	4'471	61'790	CHF 544.20	33'626'118.00	0.95	a)
CH0011178255	TX GROUP AG	7'647	0	0	7'647	CHF 92.50	707'347.50	0.02	a)
CH0019107025	APG SGA SA	3'339	0	0	3'339	CHF 180.00	601'020.00	0.02	a)
CH0039542854	MCH GROUP AG	9'399	0	0	9'399	CHF 4.50	42'295.50	0.00	a)
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	10'615	0	0	10'615	CHF 1.54	16'347.10	0.00	a)
Diverse							34'993'128.10	0.98	
Bezugsrechte							47'198.48	0.00	
CH1215218640	MCH GROUP AG-RTS	9'399	0	9'399	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH1220912898	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	0	5'168'406	5'168'406	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH1228538257	CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	0	5'487'226	5'487'226	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH1234292360	ORASCOM DEVELOPMENT-RTS	0	28'173	28'173	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH1252979377	LUZERNER KANTONALBANK AG	0	38'130	38'130	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH1291444144	AUTONEUM HOLDING AG-RIGHTS	0	7'579	3	7'576	CHF 6.23	47'198.48	0.00	a)
Diverse							47'198.48	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Futures							0.00	0.00	
12/22	SWISS MKT IX FUTR DEC22	231	102	333	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/22	SWISS MID CAP FUT DEC22	81	0	81	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/23	SWISS MKT IX FUTR MAR23	0	417	417	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/23	SWISS MID CAP FUT MAR23	0	81	81	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MID CAP FUT JUN23	0	81	81	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MKT IX FUTR JUN23	0	451	451	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MKT IX FUTR SEP23	0	386	386	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MID CAP FUT SEP23	0	81	81	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	0	273	29	244 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	SWISS MID CAP FUT DEC23	0	81	0	81 CHF	0.00	0.00	0.00	a)

Vermögensaufstellung		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		8'264'682.12	0.23
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte		3'523'997'757.23	99.12
Bezugsrechte		47'198.48	0.00
Sonstige Vermögenswerte		23'053'803.66	0.65
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'555'363'441.49	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-196'198.04	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'555'167'243.45	

Bewertungskategorien		Kurswert CHF	in % 7)
a)	Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	3'524'044'955.71	99.12
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.96854454
USD	1 = CHF	0.91480000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	28'773'155.22	0.809
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
ASTT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.007	0.00 - 0.02	-	0.008
DA CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.007	0.00 - 0.02	-	0.008
DT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.007	0.00 - 0.02	-	0.008
FA CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.007	0.00 - 0.02	-	0.008
GT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.007	0.00 - 0.02	-	0.008
NT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.007	0.00 - 0.02	-	0.008

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	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: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
ASTT CHF	0.160	1.000	0.110	0.050	4.000
DA CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	4.000
DT CHF	0.160	0.400	0.110	0.050	4.000
FA CHF	0.190	0.500	0.090	0.100	4.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	4.000
NT CHF	-	-	-	-	4.000

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

SPI® TR Swiss Performance Index

9 TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt.

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DA CHF	Nein	CHF	4.45000	1.55750	2.89250
FA CHF	Nein	CHF	4.40000	1.54000	2.86000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
ASTT CHF 34)	Nein	CHF	3.674	-	3.674
DT CHF	Nein	CHF	3.569	1.249	2.320
GT CHF	Nein	CHF	5.138	1.798	3.340
NT CHF	Nein	CHF	5.523	1.933	3.590

12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 21 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 aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugute sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen 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.