

# SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE AMBITION

## Halbjahresbericht per 31.03.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	504078	CHF
CT CHF	37873499	CHF
GT CHF	119255639	CHF
NT CHF	132580447	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	18
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II	18
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	18
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	19
8	Pauschale Verwaltungskommission	19
9	Benchmark	19
10	TER	19
11	Fussnoten	20
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	21

# 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	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		216'316'523.69	191'030'776.34	172'460'202.10	191'184'055.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'830'564.170	-	-	-
<b>Klasse AA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		200'669'808.05	183'606'684.98	166'259'542.06	184'791'751.23
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		181'054.397	181'428.379	173'429.415	161'938.051
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'108.3399	1'012.0064	958.6583	1'141.1300
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		1'109.7807	1'013.2208	959.6169	1'141.7000
Ausschüttung je Anteil		-	5.15	2.45	3.80
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.53 %	1.55 %	1.54 %	1.58 %
<b>Klasse CT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'905'552.94	6'561'230.45	6'009'604.05	6'392'304.07
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		59'673.353	62'363.916	60'657.991	54'592.528
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		115.7226	105.2088	99.0736	117.0900
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		115.8730	105.3350	99.1726	117.1500
Thesaurierung je Anteil		-	1.25	1.01	1.11
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.85 %	0.86 %	0.85 %	0.89 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'678'646.07	862'860.91	191'055.99	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		24'010.000	8'510.000	2'010.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.5638	101.3938	95.0527	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		111.7088	101.5154	95.1478	
Thesaurierung je Anteil		-	1.41	0.27	
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.64 %	0.65 %	0.64 %	
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'062'516.63			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		58'392.035			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.8244			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		103.9593			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.04 %			

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 AA CHF	10.07 %	4.77 %	-15.75 %	10.55 %
Klasse CT CHF	10.45 %	5.49 %	-15.15 %	11.32 %
Klasse GT CHF (Lancierung 29.06.2022)	10.55 %	5.96 %	-2.49 %	-
Klasse NT CHF (Lancierung 22.02.2024)	3.96 %	-	-	-

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)	31.03.2024	30.09.2023
Bankguthaben auf Sicht	5'066'990.78	4'050'489.20
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	124'695'655.38	107'377'266.91
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'012'828.79	1'943'481.92
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	82'755'124.79	77'427'346.04
Andere Anlagen - Metallkonten	935'404.11	1'711.13
Derivative Finanzinstrumente	93'762.44	-30'786.54
Sonstige Vermögenswerte	1'019'601.59	498'701.31
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>216'579'367.88</b>	<b>191'268'209.97</b>
Andere Verbindlichkeiten	-262'844.19	-237'433.63
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>216'316'523.69</b>	<b>191'030'776.34</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		181'428.379	173'429.415
Ausgegebene Anteile		11'143.776	21'544.601
Zurückgenommene Anteile		-11'517.758	-13'545.637
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>181'054.397</b>	<b>181'428.379</b>
Klasse CT CHF	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		62'363.916	60'657.991
Ausgegebene Anteile		1'557.734	8'490.466
Zurückgenommene Anteile		-4'248.297	-6'784.541
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>59'673.353</b>	<b>62'363.916</b>
Klasse GT CHF	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'510.000	2'010.000
Ausgegebene Anteile		15'500.000	6'500.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>24'010.000</b>	<b>8'510.000</b>
Klasse NT CHF	von bis	Lancierung 22.02.2024 31.03.2024	
Ausgegebene Anteile		58'392.035	
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>58'392.035</b>	

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		191'030'776.34	172'460'202.10
Ausbezahlte Ausschüttung		-931'014.12	-433'299.93
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-34'527.37	-22'325.65
Saldo aus dem Anteilverkehr		6'765'595.67	8'865'174.53
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		19'485'693.17	10'161'025.29
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>216'316'523.69</b>	<b>191'030'776.34</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 31.03.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		28'609.18	47'468.62
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-377.17	-10'436.17
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		1'047'911.01	2'278'494.10
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'341.47	185.86
Erträge der Gratisaktien		2'332.98	105.99
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		658'256.95	1'441'071.98
Erträge aus Wertpapierleihe		6'125.35	14'696.70
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-7'985.53	15'855.40
<b>Total Ertrag</b>		<b>1'736'214.24</b>	<b>3'787'442.48</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-19.60	-73.33
Reglementarische Vergütungen		-1'419'314.81	-2'754'248.52
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)		0.00	10'300.13
Sonstige Aufwendungen		-359.59	-249.50
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		12'138.22	-12'758.87
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'407'555.78</b>	<b>-2'757'030.09</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>328'658.46</b>	<b>1'030'412.39</b>
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		305'623.64	-4'974'397.02
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		4'215.74	84'532.88
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		26'354.02	24'363.59
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)		0.00	-10'300.13
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>664'851.86</b>	<b>-3'845'388.29</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		18'820'841.31	14'006'413.58
<b>Gesamterfolg</b>		<b>19'485'693.17</b>	<b>10'161'025.29</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>136'780'472.30</b>	<b>63.15</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>124'695'655.38</b>	<b>57.58</b>	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	157	133	157	133 USD	1'511.96	181'122.38	0.08	a)
<b>AR</b>							<b>181'122.38</b>	<b>0.08</b>	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	1'855	0	0	1'855 EUR	41.30	74'523.97	0.03	a)
<b>AT</b>							<b>74'523.97</b>	<b>0.03</b>	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	9'700	0	0	9'700 AUD	43.00	245'094.92	0.11	a)
AU000000APA1	APA GROUP	15'002	0	15'002	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	0	20'047	0	20'047 AUD	25.70	302'744.76	0.14	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	33'645	25'895	59'540	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	13'883	56'449	70'332	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	27'052	0	0	27'052 AUD	18.13	288'198.22	0.13	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	0	63'093	0	63'093 AUD	3.39	125'682.55	0.06	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	3'729	2'942	6'671	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	14'834	0	14'834	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	0	62'734	0	62'734 AUD	2.13	78'519.35	0.04	a)
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	41'053	37'345	0	78'398 AUD	5.51	253'834.53	0.12	a)
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	11'911	13'292	11'911	13'292 AUD	30.50	238'223.33	0.11	a)
<b>AU</b>							<b>1'532'297.66</b>	<b>0.71</b>	
BE0003565737	KBC GROUP NV	2'506	633	0	3'139 EUR	69.42	211'971.72	0.10	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1'395	0	1'395	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>BE</b>							<b>211'971.72</b>	<b>0.10</b>	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	48'684	0	48'684 USD	6.10	267'569.55	0.12	a)
<b>BM</b>							<b>267'569.55</b>	<b>0.12</b>	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	2'893	17'022	2'893	17'022 CAD	24.15	273'608.67	0.13	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	12'367	0	12'367	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	0	3'133	0	3'133 CAD	77.31	161'212.31	0.07	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	9'297	0	9'297 CAD	29.92	185'142.68	0.09	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	0	4'378	0	4'378 CAD	56.90	165'802.15	0.08	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	0	10'030	4'856	5'174 CAD	68.67	236'480.65	0.11	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	8'094	2'167	8'094	2'167 CAD	30.85	44'495.51	0.02	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	1'101	1'183	2'284	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	3'764	0	3'764	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	5'922	0	5'922 CAD	8.31	32'754.54	0.02	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	2'619	0	2'619 CAD	150.10	261'648.54	0.12	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	16'394	0	0	16'394 CAD	33.83	369'138.26	0.17	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	4'117	0	4'117	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	12'439	0	0	12'439 CAD	22.13	183'218.37	0.08	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	1'996	4'475	3'524	2'947 CAD	73.59	144'344.78	0.07	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2'474	0	2'474	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	5'547	0	5'547	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA70137W1086	PARKLAND CORP	3'335	1'076	4'411	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	8'799	0	8'799 CAD	47.81	279'997.52	0.13	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	3'308	6'327	0	9'635 CAD	37.98	243'561.59	0.11	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	2'078	2'078	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	0	1'237	1'237	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0	3'327	3'327	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	3'408	3'831	3'408	3'831 CAD	73.91	188'459.26	0.09	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	9'360	0	9'360	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	1'545	4'457	6'002	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
<b>CA</b>							<b>2'769'864.83</b>	<b>1.28</b>	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	977	562	0	1'539 CHF	551.40	848'604.60	0.39	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	324	65	116	273 CHF	4'016.00	1'096'368.00	0.51	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	5'917	348	0	6'265 CHF	486.30	3'046'669.50	1.41	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	62'523	4'643	1'139	66'027 CHF	87.37	5'768'778.99	2.66	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	24'426	1'848	965	25'309 CHF	229.70	5'813'477.30	2.68	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	12'151	558	1'625	11'084 CHF	81.66	905'119.44	0.42	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	43'338	2'427	2'487	43'278 CHF	41.89	1'812'915.42	0.84	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	1'587	717	227	2'077 CHF	261.10	542'304.70	0.25	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	3'806	558	744	3'620 CHF	540.20	1'955'524.00	0.90	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1'790	105	0	1'895 CHF	632.20	1'198'019.00	0.55	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1'070	62	18	1'114 CHF	1'288.00	1'434'832.00	0.66	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	2'197	0	2'197 CHF	251.00	551'447.00	0.25	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	524	102	108	518 CHF	533.00	276'094.00	0.13	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	93'497	4'672	2'904	95'265 CHF	95.75	9'121'623.75	4.21	a)
CH0114405324	GARMIN LTD	0	389	389	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0126881561	SWISS RE AG	3'795	178	438	3'535 CHF	115.95	409'883.25	0.19	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	18'720	3'316	1'448	20'588 CHF	137.50	2'830'850.00	1.31	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	97'738	5'531	4'391	98'878 CHF	27.74	2'742'875.72	1.27	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	3'376	1'102	0	4'478 CHF	268.60	1'202'790.80	0.56	a)
CH0432492467	ALCON INC	27'497	1'323	2'543	26'277 CHF	74.74	1'963'942.98	0.91	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	487	487	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	12'504	12'504	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>CH</b>							<b>43'522'120.45</b>	<b>20.10</b>	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	13'020	0	2'609	10'411 EUR	14.58	147'676.55	0.07	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	0	1'788	0	1'788 EUR	66.90	116'357.84	0.05	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	3'627	3'573	3'627	3'573 EUR	74.50	258'935.32	0.12	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	923	0	923	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	3'172	3'205	6'377	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	1'812	1'140	644	2'308 EUR	180.46	405'152.73	0.19	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	2'497	0	0	2'497 EUR	176.96	429'828.95	0.20	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	0	1'071	0	1'071 EUR	277.80	289'416.79	0.13	a)
DE000A1EWWWO	ADIDAS AG	1'644	0	1'644	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	18'813	0	0	18'813 EUR	12.89	235'800.38	0.11	a)
<b>DE</b>							<b>1'883'168.56</b>	<b>0.87</b>	
DK0060252690	PANDORA A/S	1'688	316	0	2'004 DKK	1'114.50	291'272.81	0.13	a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	1'532	1'948	3'480	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	5'410	1'245	1'633	5'022 DKK	881.30	577'195.09	0.27	a)
<b>DK</b>							<b>868'467.90</b>	<b>0.40</b>	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	2'995	0	2'995	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	12'505	0	0	12'505 EUR	11.04	134'293.43	0.06	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	639	2'031	451	2'219 EUR	112.85	243'590.80	0.11	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	5'116	0	5'116	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	0	14'062	0	14'062 EUR	15.81	216'193.98	0.10	a)
<b>ES</b>							<b>594'078.21</b>	<b>0.27</b>	
FI0009007884	ELISA OYJ	2'178	3'337	0	5'515 EUR	41.35	221'831.41	0.10	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	2'114	0	2'114	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	8'401	0	8'401	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
<b>FI</b>							<b>221'831.41</b>	<b>0.10</b>	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	0	18'893	0	18'893 EUR	13.82	253'913.19	0.12	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	2'234	4'868	3'056	4'046 EUR	63.47	249'802.27	0.12	a)
FR0000120578	SANOFI	1'741	0	1'741	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	12'915	3'267	5'615	10'567 EUR	34.82	357'865.74	0.17	a)
FR0000120644	DANONE	4'742	0	0	4'742 EUR	59.89	276'259.91	0.13	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	165	0	81	84 EUR	833.70	68'122.58	0.03	a)
FR0000121220	SODEXO SA	465	0	465	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	0	644	644	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	4'974	0	0	4'974 EUR	24.00	116'123.21	0.05	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	877	1'886	877	1'886 EUR	209.65	384'625.93	0.18	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	4'888	0	4'888	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	2'484	0	1'380	1'104 EUR	101.05	108'519.40	0.05	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	8'168	2'172	10'340	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	5'308	0	0	5'308 EUR	65.86	340'059.29	0.16	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0010208488	ENGIE	7'053	9'680	4'046	12'687 EUR	15.51	191'413.58	0.09	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	2'804	0	2'804	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	2'516	8'815	11'331	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	0	4'320	0	4'320 EUR	41.04	172'461.88	0.08	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	8'282	0	8'282 EUR	35.52	286'160.83	0.13	a)
<b>FR</b>							<b>2'805'327.81</b>	<b>1.30</b>	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	2'684	0	1'316	1'368 AUD	121.76	97'877.95	0.05	a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	9'469	29'124	0	38'593 GBP	671.40	294'821.63	0.14	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	54'708	0	28'978	25'730 GBP	619.00	181'217.40	0.08	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	0	20'956	0	20'956 GBP	1'042.00	248'453.76	0.11	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	0	3'649	0	3'649 GBP	5'017.00	208'299.12	0.10	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	625	0	0	625 GBP	10'678.00	75'934.55	0.04	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	86'263	0	59'340	26'923 GBP	183.20	56'120.10	0.03	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	7'094	8'443	0	15'537 GBP	1'213.00	214'435.87	0.10	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	0	41'377	0	41'377 GBP	270.40	127'301.98	0.06	a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	145'712	0	0	145'712 GBP	127.65	211'634.08	0.10	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	4'871	1'187	6'058	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1KJJ408	WHITBREAD PLC	0	936	936	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	9'968	0	9'968	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	8'254	0	0	8'254 GBP	3'424.00	321'564.20	0.15	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	7'850	0	7'850	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	1'953	0	1'953	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	1'283	0	0	1'283 USD	69.95	80'834.09	0.04	a)
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	264'238	0	264'238	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	0	16'138	0	16'138 GBP	220.50	40'488.14	0.02	a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	84'205	0	0	84'205 GBP	296.60	284'170.18	0.13	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	0	60'810	60'810	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	23'406	0	23'406 GBP	831.20	221'361.56	0.10	a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	4'402	1'825	0	6'227 GBP	1'708.60	121'056.67	0.06	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	18'322	4'025	11'679	10'668 GBP	2'625.00	318'626.42	0.15	a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	0	8'277	8'277	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	0	14'494	0	14'494 GBP	700.20	115'472.84	0.05	a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	0	13'003	0	13'003 GBP	658.20	97'380.26	0.04	a)
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	3'886	0	0	3'886 USD	85.44	299'050.27	0.14	a)
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	1'943	0	0	1'943 GBP	17'291.11	382'265.63	0.18	a)
<b>GB</b>							<b>3'998'366.70</b>	<b>1.85</b>	
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	0	17'000	17'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	0	34'000	34'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	153'000	88'000	241'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	0	3'700	0	3'700 HKD	85.65	36'470.73	0.02	a)
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	0	48'000	48'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0823032773	LINK REIT	26'000	12'600	26'000	12'600 HKD	33.65	48'794.51	0.02	a)
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	88'500	15'000	0	103'500 HKD	20.95	249'539.75	0.12	a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	0	38'500	38'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	62'200	62'200	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	14'000	0	14'000 HKD	25.45	41'004.47	0.02	a)
<b>HK</b>							<b>375'809.46</b>	<b>0.17</b>	
CRH ID	CRH PLC	3'614	0	3'614	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE0001827041	CRH PLC	0	3'614	0	3'614 GBP	6'828.00	280'770.28	0.13	a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	2'214	0	2'214 EUR	42.27	91'035.73	0.04	a)
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	801	830	0	1'631 USD	346.61	509'184.54	0.24	a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	639	0	639	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	22'513	0	22'513	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	1'464	221	1'243 USD	300.20	336'094.94	0.16	a)
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	4'041	4'041	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>IE</b>							<b>1'217'085.49</b>	<b>0.56</b>	
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	547	0	0	547 USD	164.01	80'804.92	0.04	a)
<b>IL</b>							<b>80'804.92</b>	<b>0.04</b>	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	13'631	0	0	13'631 EUR	23.46	311'069.72	0.14	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	83'812	0	0	83'812 EUR	3.36	274'179.57	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0003128367	ENEL SPA	0	5'643	5'643	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	10'843	0	0	10'843 EUR	11.61	122'404.29	0.06	a)
<b>IT</b>							<b>707'653.58</b>	<b>0.33</b>	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	66'727	0	66'727	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000303709	AEGON NV	7'823	0	7'823	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	2'249	0	0	2'249 EUR	145.20	317'656.74	0.15	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	1'491	0	0	1'491 USD	247.77	332'741.16	0.15	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	200	42	0	242 EUR	892.20	210'029.16	0.10	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	63	0	63	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	3'639	0	3'639	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011821202	ING GROEP NV	0	3'935	0	3'935 EUR	15.25	58'358.30	0.03	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	1'513	3'102	1'513	3'102 EUR	69.18	208'748.98	0.10	a)
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	3'901	3'901	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>NL</b>							<b>1'127'534.34</b>	<b>0.52</b>	
NO0010096985	EQUINOR ASA	5'202	0	5'202	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010345853	AKER BP ASA	0	6'376	0	6'376 NOK	269.80	142'822.53	0.07	a)
<b>NO</b>							<b>142'822.53</b>	<b>0.07</b>	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	0	1'508	0	1'508 NZD	34.25	27'826.09	0.01	a)
<b>NZ</b>							<b>27'826.09</b>	<b>0.01</b>	
PTGAL0AM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	4'552	0	4'552	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>PT</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	15'782	0	3'867	11'915 SEK	174.58	175'220.69	0.08	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	13'316	0	0	13'316 SEK	290.10	325'400.62	0.15	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4'983	3'800	8'783	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	9'492	9'492	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	0	7'498	0	7'498 SEK	307.10	193'964.44	0.09	a)
<b>SE</b>							<b>694'585.75</b>	<b>0.32</b>	
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	11'072	0	11'072	0 USD	0.00	0.00	0.00	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	32'100	0	0	32'100 SGD	13.49	288'996.16	0.13	a)
<b>SG</b>							<b>288'996.16</b>	<b>0.13</b>	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	0	4'261	0	4'261 USD	54.81	210'354.35	0.10	a)
BMG491BT1088	INVESCO LTD	13'519	2'601	16'120	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1'256	0	1'256	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00059YS762	LINDE PLC	371	0	195	176 USD	464.32	73'605.49	0.03	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	1'792	0	1'507	285 USD	312.68	80'264.80	0.04	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	5'034	0	5'034	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	505	0	505 USD	86.91	39'531.32	0.02	a)
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	0	991	991	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	19'958	5'031	17'512	7'477 USD	17.60	118'527.80	0.05	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	1'616	0	987	629 USD	113.66	64'392.97	0.03	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	1'251	1'861	0	3'112 USD	182.10	510'422.37	0.24	a)
US00724F1012	ADOBE INC	1'117	122	0	1'239 USD	504.60	563'117.10	0.26	a)
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	1'517	440	0	1'957 USD	180.49	318'144.29	0.15	a)
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	505	0	505 USD	108.76	49'469.87	0.02	a)
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	9'386	0	9'386	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	5'417	0	1'158	4'259 USD	152.26	584'081.74	0.27	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	13'324	228	0	13'552 USD	150.93	1'842'294.81	0.85	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	1'595	0	1'595	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0231351067	AMAZON.COM INC	14'366	1'312	0	15'678 USD	180.38	2'547'177.47	1.18	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	2'237	318	320	2'235 USD	227.69	458'354.66	0.21	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	1'806	1'770	2'013	1'563 USD	197.59	278'166.04	0.13	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	997	351	1'348	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	0	585	0	585 USD	438.44	231'018.20	0.11	a)
US0311621009	AMGEN INC	1'156	628	0	1'784 USD	284.32	456'859.25	0.21	a)
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	0	7'620	7'620	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	818	0	818	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ELEVANCE HEALTH INC	550	357	0	907 USD	518.54	423'613.42	0.20	a)
US0378331005	APPLE INC	24'046	0	3'348	20'698 USD	171.48	3'196'848.24	1.48	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	0	2'676	0	2'676 USD	206.23	497'070.64	0.23	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	2'238	2'238	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	336	969	0	1'305 USD	260.42	306'101.18	0.14	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	390	1'274	0	1'664 USD	249.74	374'301.52	0.17	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	29	0	29	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	513	513	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	3'782	0	0	3'782 USD	37.92	129'172.49	0.06	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	6'633	0	0	6'633 USD	57.62	344'241.65	0.16	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	1'119	0	1'119	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	140	0	0	140 USD	3'627.88	457'468.41	0.21	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	2'366	0	2'366	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	0	3'637	539	3'098 USD	65.31	182'238.97	0.08	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6'422	2'015	0	8'437 USD	54.23	412'104.94	0.19	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	1'297	184	0	1'481 USD	204.86	273'270.27	0.13	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	523	250	231	542 USD	1'325.41	647'037.86	0.30	a)
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	0	913	913	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	1'267	387	618	1'036 USD	208.55	194'603.26	0.09	a)
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0	812	812	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	0	1'596	367	1'229 USD	363.19	402'036.91	0.19	a)
US1264081035	CSX CORP	0	4'027	0	4'027 USD	37.07	134'457.30	0.06	a)
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	8'012	2'725	10'737	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	1'367	0	1'367	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	5'414	1'203	6'617	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	939	1'609	0	2'548 USD	148.89	341'700.11	0.16	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	2'434	2'078	1'620	2'892 USD	111.90	291'479.85	0.13	a)
US1491231015	CATERPILLAR INC	999	546	0	1'545 USD	366.43	509'917.21	0.24	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	0	1'031	0	1'031 USD	78.48	72'878.23	0.03	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	672	156	828	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	2'010	2'010	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	4'163	898	3'901	1'160 USD	157.74	164'808.64	0.08	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	119	0	34	85 USD	2'906.77	222'540.86	0.10	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	2'714	2'856	2'714	2'856 USD	104.31	268'326.96	0.12	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	10'424	897	0	11'321 USD	49.91	508'923.52	0.23	a)
US1729081059	CINTAS CORP	0	587	0	587 USD	687.03	363'240.25	0.17	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	0	5'304	0	5'304 USD	63.24	302'117.26	0.14	a)
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	1'665	1'665	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	9'952	1'682	7'827	3'807 USD	61.18	209'784.07	0.10	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	391	0	391 USD	73.29	25'810.81	0.01	a)
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	0	4'200	0	4'200 USD	90.05	340'653.75	0.16	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	11'551	1'070	0	12'621 USD	43.35	492'791.30	0.23	a)
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	3'736	0	3'736	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	3'218	0	0	3'218 USD	90.81	263'208.48	0.12	a)
US22052L1044	CORTEVA INC	0	3'070	0	3'070 USD	57.67	159'466.14	0.07	a)
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	228	0	0	228 USD	732.63	150'452.60	0.07	a)
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	2'637	2'300	3'331	1'606 USD	105.83	153'085.66	0.07	a)
US2358511028	DANAHER CORP	186	0	186	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	1'621	219	1'621	219 USD	167.15	32'970.89	0.02	a)
US23918K1088	DAVITA INC	1'082	1'236	1'686	632 USD	138.05	78'583.91	0.04	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	408	0	366	42 USD	941.26	35'607.30	0.02	a)
US2441991054	DEERE & CO	0	219	0	219 USD	410.74	81'019.82	0.04	a)
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	971	0	971	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	6'907	0	6'907 USD	50.18	312'176.55	0.14	a)
US2521311074	DEXCOM INC	728	0	728	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	0	2'994	1'372	1'622 USD	198.17	289'513.57	0.13	a)
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3'121	0	1'641	1'480 USD	131.09	174'747.69	0.08	a)
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	608	0	608 USD	59.55	32'611.10	0.02	a)
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	78	0	78 USD	496.88	34'908.11	0.02	a)
US2605571031	DOW INC	5'503	0	5'503	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	3'290	0	0	3'290 USD	24.30	72'008.26	0.03	a)
US2786421030	EBAY INC	4'108	1'832	0	5'940 USD	52.78	282'381.34	0.13	a)
US2788651006	ECOLAB INC	1'752	0	1'752	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3'649	786	1'880	2'555 USD	95.56	219'911.13	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	0	2'663	0	2'663 USD	132.67	318'217.50	0.15	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	3'358	2'879	3'358	2'879 USD	113.42	294'111.14	0.14	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	0	413	0	413 USD	120.98	45'003.24	0.02	a)
US29444U7000	EQUINIX INC	446	372	446	372 USD	825.33	276'535.40	0.13	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	2'990	5'185	0	8'175 USD	38.01	279'876.09	0.13	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	0	3'815	3'815	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	4'205	0	4'205	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	4'334	0	569	3'765 USD	116.24	394'185.59	0.18	a)
US3024913036	FMC CORP	3'709	2'672	5'683	698 USD	63.70	40'047.46	0.02	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	2'376	411	0	2'787 USD	485.58	1'218'927.63	0.56	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	811	0	811	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	5'318	1'976	4'737	2'557 USD	74.18	170'843.21	0.08	a)
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	6'052	0	6'052	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3377381088	FISERV INC	1'892	0	1'892	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	3'605	1'136	3'605	1'136 USD	86.02	88'015.25	0.04	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	0	3'726	0	3'726 USD	84.67	284'153.21	0.13	a)
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	1'920	1'920	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	1'578	5'591	0	7'169 USD	28.62	184'802.73	0.09	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	2'132	2'132	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	4'018	500	0	4'518 USD	69.97	284'733.30	0.13	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	868	614	1'482	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	4'838	652	0	5'490 USD	73.25	362'209.75	0.17	a)
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	0	1'126	0	1'126 USD	417.69	423'616.27	0.20	a)
US3841091040	GRACO INC	2'042	0	2'042	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	WW GRAINGER INC	334	0	334	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	1'116	0	1'116	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	3'828	0	3'828 USD	103.05	355'303.99	0.16	a)
US4180561072	HASBRO INC	0	7'606	2'121	5'485 USD	56.52	279'227.99	0.13	a)
US4278661081	HERSHEY CO/THE	0	1'161	1'161	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	0	386	0	386 USD	213.31	74'161.53	0.03	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	3'447	0	3'447	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	762	1'398	0	2'160 USD	383.60	746'298.40	0.34	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	0	14'981	0	14'981 USD	20.68	279'043.24	0.13	a)
US4435106079	HUBBELL INC	702	0	0	702 USD	415.05	262'432.55	0.12	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	99	0	99	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	0	850	0	850 USD	346.72	265'447.10	0.12	a)
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	0	23'691	23'691	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523271090	ILLUMINA INC	0	520	0	520 USD	137.32	64'315.74	0.03	a)
US45337C1027	INCYTE CORP	4'212	0	0	4'212 USD	56.97	216'129.85	0.10	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	3'073	0	3'073 USD	94.95	262'807.46	0.12	a)
US45784P1012	INSULET CORP	0	629	0	629 USD	171.40	97'105.01	0.04	a)
US4581401001	INTEL CORP	0	6'687	3'223	3'464 USD	44.17	137'811.50	0.06	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	2'153	660	0	2'813 USD	190.96	483'829.45	0.22	a)
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	4'736	3'846	0	8'582 USD	39.02	301'617.08	0.14	a)
US4612021034	INTUIT INC	879	0	0	879 USD	650.00	514'614.95	0.24	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	544	231	544	231 USD	399.09	83'035.34	0.04	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	3'517	826	2'776	1'567 USD	80.21	113'208.15	0.05	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	4'218	0	422	3'796 USD	200.30	684'837.16	0.32	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	2'376	2'891	0	5'267 USD	158.19	750'451.29	0.35	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	2'327	3'298	2'327	3'298 USD	37.06	110'087.05	0.05	a)
US4878361082	KELLANOVA	3'881	3'244	1'662	5'463 USD	57.29	281'896.83	0.13	a)
US49177J1025	KENVUE INC	0	6'218	6'218	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	9'667	9'667	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	0	12'456	0	12'456 USD	15.81	177'374.27	0.08	a)
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1'956	251	1'956	251 USD	156.38	35'353.72	0.02	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	2'166	599	0	2'765 USD	129.35	322'137.83	0.15	a)
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	0	3'491	3'491	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	0	32'684	15'312	17'372 USD	18.34	286'965.25	0.13	a)
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	7'628	0	7'628 USD	36.90	253'522.91	0.12	a)
US5018892084	LKQ CORP	0	5'953	5'953	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	1'830	336	1'494 USD	218.46	293'969.78	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	521	0	0	521 USD	971.57	455'923.50	0.21	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	1'570	0	376	1'194 USD	777.96	836'646.03	0.39	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	1'090	832	1'090	832 USD	254.73	190'890.18	0.09	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	11'138	36'434	47'572	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	6'920	4'095	0	11'015 USD	28.34	281'167.11	0.13	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	1'442	913	908	1'447 USD	201.50	262'617.55	0.12	a)
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	1'834	0	464	1'370 USD	481.57	594'237.64	0.27	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	333	0	0	333 USD	281.95	84'566.14	0.04	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	320	663	983	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	6'047	0	0	6'047 USD	131.95	718'670.02	0.33	a)
US59156R1086	METLIFE INC	0	4'651	0	4'651 USD	74.11	310'458.33	0.14	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	11'162	122	0	11'284 USD	420.72	4'275'987.22	1.97	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1'911	0	1'911	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	1'726	0	1'726	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US59522J1034	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0	1'947	1'947	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	3'931	572	0	4'503 USD	67.25	272'756.05	0.13	a)
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	0	3'689	0	3'689 USD	70.00	232'587.76	0.11	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	1'959	2'846	4'805	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64110D1046	NETAPP INC	478	1'871	0	2'349 USD	104.97	222'089.68	0.10	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	129	344	158	315 USD	607.33	172'311.97	0.08	a)
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0	251	0	251 USD	137.92	31'180.36	0.01	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	5'066	0	5'066	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFELOCK INC	0	3'434	0	3'434 USD	22.40	69'283.29	0.03	a)
US6703461052	NUCOR CORP	1'931	677	1'759	849 USD	197.90	151'333.00	0.07	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	4'190	0	112	4'078 USD	903.56	3'318'825.21	1.53	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	122	0	122	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	0	334	334	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6819191064	OMNICOM GROUP	1'158	0	1'158	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6826801036	ONEOK INC	0	3'156	0	3'156 USD	80.17	227'891.98	0.11	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	1'228	0	1'228	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	0	556	556	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69047Q1022	OVINTIV INC	0	804	804	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	2'070	0	1'048	1'022 USD	166.80	153'541.97	0.07	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1'358	0	1'358	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	2'134	578	0	2'712 USD	144.90	353'947.00	0.16	a)
US69370C1009	PTC INC	0	1'258	0	1'258 USD	188.94	214'084.25	0.10	a)
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	0	402	0	402 USD	189.78	68'715.81	0.03	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	726	452	1'178	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	1'666	0	1'666	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7134481081	PEPSICO INC	969	0	245	724 USD	175.01	114'125.21	0.05	a)
US7170811035	PFIZER INC	14'386	0	14'386	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	0	2'220	2'220	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	269	0	269	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	5'068	1'180	2'794	3'454 USD	162.25	504'762.64	0.23	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2'795	330	0	3'125 USD	117.40	330'444.31	0.15	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	3'006	561	0	3'567 USD	120.62	387'527.56	0.18	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	2'905	876	331	3'450 USD	169.30	526'085.36	0.24	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	1'810	2'324	2'652	1'482 USD	133.11	177'680.21	0.08	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	504	0	38	466 USD	962.49	403'982.27	0.19	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	2'764	0	0	2'764 USD	21.04	52'379.81	0.02	a)
US7595091023	RELIANCE INC	1'035	0	1'035	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7703231032	ROBERT HALF INC	2'294	0	2'294	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	184	0	184	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	2'458	0	0	2'458 USD	301.18	666'788.61	0.31	a)
US8064071025	HENRY SCHEIN INC	0	540	540	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81762P1021	SERVICENOW INC	701	0	0	701 USD	762.40	481'372.27	0.22	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0	1'126	0	1'126 USD	347.33	352'257.99	0.16	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	2'052	401	2'453	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	592	1'888	958	1'522 USD	125.87	172'550.83	0.08	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	866	0	0	866 USD	296.22	231'053.44	0.11	a)
US8574771031	STATE STREET CORP	3'855	0	0	3'855 USD	77.32	268'470.39	0.12	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US8636671013	STRYKER CORP	0	141	141	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716071076	SYNOPSIS INC	744	201	452	493 USD	571.50	253'771.77	0.12	a)
US8716581035	SYNCHRONY FINANCIAL	7'018	1'920	0	8'938 USD	43.12	347'135.69	0.16	a)
US8718291078	SYSCO CORP	4'075	0	1'150	2'925 USD	81.18	213'872.57	0.10	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	1'562	526	1'036 USD	163.22	152'304.70	0.07	a)
US88160R1014	TESLA INC	3'857	347	0	4'204 USD	175.79	665'636.36	0.31	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	143	0	0	143 USD	581.21	74'859.91	0.03	a)
US88579Y1010	3M CO	3'148	355	0	3'503 USD	106.07	334'666.98	0.15	a)
US89400J1079	TRANSUNION	1'458	0	1'458	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8962391004	TRIMBLE INC	0	3'480	0	3'480 USD	64.36	201'732.30	0.09	a)
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	6'515	1'722	8'237	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	8'074	0	2'352	5'722 USD	76.99	396'791.48	0.18	a)
US90364P1057	UIPATH INC - CLASS A	0	4'058	0	4'058 USD	22.67	82'859.77	0.04	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	0	517	0	517 USD	522.88	243'485.29	0.11	a)
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	0	1'958	0	1'958 USD	245.93	433'714.92	0.20	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	640	0	103	537 USD	721.11	348'783.53	0.16	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	1'633	0	668	965 USD	494.70	429'981.12	0.20	a)
US9182041080	VF CORP	12'626	3'339	15'965	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	821	285	631	475 USD	222.83	95'333.92	0.04	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	951	0	951	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	0	491	0	491 USD	231.69	102'463.44	0.05	a)
US92338C1036	VERALTO CORP	0	1'331	0	1'331 USD	88.66	106'288.42	0.05	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	5'889	10'506	3'773	12'622 USD	41.96	477'027.94	0.22	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	1'235	0	1'235	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1'088	0	189	899 USD	418.01	338'474.94	0.16	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	1'743	0	1'743 USD	81.67	128'215.37	0.06	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	3'468	0	0	3'468 USD	279.08	871'741.99	0.40	a)
US92942W1071	WK KELLOGG CO	0	970	970	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	0	1'720	0	1'720 USD	145.68	225'688.04	0.10	a)
US9311421039	WALMART INC	1'181	2'355	1'181	2'355 USD	60.17	127'629.51	0.06	a)
US9699041011	WILLIAMS-SONOMA INC	0	1'087	0	1'087 USD	317.53	310'881.21	0.14	a)
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	1'334	703	696	1'341 USD	272.75	329'438.01	0.15	a)
US98419M1009	XYLEM INC	2'519	0	2'519	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	2'644	1'185	3'829	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	2'531	0	2'531 USD	131.98	300'871.07	0.14	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	236	0	236	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	3'537	5'004	8'541	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980G1022	ZSCALER INC	0	304	0	304 USD	192.63	52'744.56	0.02	a)
<b>US</b>							<b>61'101'825.91</b>	<b>28.21</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>2'012'828.79</b>	<b>0.93</b>	
CH0118075610	7.0000 % FTIMB 7 10/31/15 TIMB	370	0	0	370 USD	0.00%	0.00	0.00	c)
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	2'300	0	0	2'300 USD	97.16%	2'012'828.79	0.93	a)
<b>USD</b>							<b>2'012'828.79</b>	<b>0.93</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1328441832	PROCIMMO REAL ESTATE SIC-RTS	0	1'147	1'147	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	17'089	17'089	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	0	6'643	6'643	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>10'071'988.13</b>	<b>4.65</b>	
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INTERSWISS	2'322	0	700	1'622 CHF	179.00	290'338.00	0.13	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	1'729	0	0	1'729 CHF	216.00	373'464.00	0.17	a)
CH0002782263	LA FONCIERE	2'419	0	800	1'619 CHF	136.50	220'993.50	0.10	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	500	0	0	500 CHF	293.00	146'500.00	0.07	a)
CH0009778769	IMMOFONDS	802	0	200	602 CHF	568.00	341'936.00	0.16	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	3'463	0	600	2'863 CHF	227.00	649'901.00	0.30	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDENTIAL ANFOS	6'971	0	1'500	5'471 CHF	87.80	480'353.80	0.22	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDENTIAL FONCIPARS	2'655	0	0	2'655 CHF	137.00	363'735.00	0.17	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA	13'182	0	2'500	10'682 CHF	143.50	1'532'867.00	0.71	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMERCIAL SWISSREAL	6'865	0	1'500	5'365 CHF	66.00	354'090.00	0.16	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	1'096	0	0	1'096 CHF	221.00	242'216.00	0.11	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT FUND	982	0	0	982 CHF	194.00	190'508.00	0.09	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	7'054	0	0	7'054 CHF	19.90	140'374.60	0.06	a)
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	1'878	0	800	1'078 CHF	149.00	160'622.00	0.07	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	3'924	0	1'000	2'924 CHF	148.00	432'752.00	0.20	a)
CH0033624211	PROCIMMO SWISS COMMERCIAL	1'147	0	0	1'147 CHF	146.00	167'462.00	0.08	a)
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FUND	638	0	0	638 CHF	173.00	110'374.00	0.05	a)
CH0037430946	SWC (CH) REF RESPONSIBLE IFCA FA CHF	2'161	0	800	1'361 CHF	170.50	232'050.50	0.11	a)
CH0039415010	REALSTONE SWISS PROPERTY	3'383	0	1'000	2'383 CHF	129.00	307'407.00	0.14	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	3'310	0	900	2'410 CHF	126.00	303'660.00	0.14	a)
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	3'540	0	800	2'740 CHF	149.00	408'260.00	0.19	a)
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	7'000	0	0	7'000 CHF	13.25	92'750.00	0.04	a)
CH0293784861	SWISS LIFE REF CH SW PROPERT	2'260	0	0	2'260 CHF	122.50	276'850.00	0.13	a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	3'574	0	1'000	2'574 CHF	159.50	410'553.00	0.19	a)
<b>CH</b>							<b>8'230'017.40</b>	<b>3.80</b>	
IE00BYLVK39	UBS ETF BLOOMBERG COMMODITY CMCI H CHF	144'039	0	0	144'039 CHF	12.79	1'841'970.73	0.85	a)
<b>IE</b>							<b>1'841'970.73</b>	<b>0.85</b>	

### Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

**72'683'136.66 33.56**

#### Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

**72'683'136.66 33.56**

CH0027382941	SWC (CH) BF RESPONSIBLE CHF NT CHF	14'775	730	697	14'808 CHF	1'393.27	20'632'046.51	9.53	a)
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	77'176	0	0	77'176 CHF	47.25	3'646'504.02	1.68	a)
CH0388442359	SWC (CH) EF RESPONSIBLE SMC CH (II) NT CHF	78'584	4'624	0	83'208 CHF	124.14	10'329'246.76	4.77	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	29'319	0	0	29'319 CHF	147.44	4'322'654.00	2.00	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS. GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	109'046	18'333	0	127'379 CHF	86.48	11'015'160.33	5.09	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	42'930	0	0	42'930 CHF	93.41	4'010'019.91	1.85	a)
<b>CH</b>							<b>53'955'631.53</b>	<b>24.91</b>	
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	6'913	0	0	6'913 USD	293.98	1'830'499.13	0.85	a)
LU0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING MARKETS NT	60'733	0	0	60'733 USD	131.12	7'172'554.18	3.31	a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	43'398	0	0	43'398 CHF	129.48	5'619'117.89	2.59	a)
LU2108482667	SWC (LU) BF RESPONSIBLE EMMA OPPTS NT	42'842	0	0	42'842 USD	106.39	4'105'333.93	1.90	a)
<b>LU</b>							<b>18'727'505.13</b>	<b>8.65</b>	

#### Derivative Finanzinstrumente

**93'762.44 0.04**

#### Futures

**0.00 0.00**

12/23	EURO STOXX 50 DEC23	-67	67	0	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	3	50	53	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	-20	24	4	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	11	0	11	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	MSCI EMGMKT DEC23	30	0	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NASDAQ 100 E-MINI DEC23	11	3	14	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	-8	8	0	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	AUST 10Y BOND FUT DEC23	28	0	28	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	BCOM COMDTY IND DEC23	0	202	202	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	-10	10	0	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	CAN 10YR BOND FUT DEC23	-25	25	0	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
02/24	HANG SENG IDX FUT FEB24	0	11	11	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NIKKEI 225 (SGX) MAR24	0	18	18	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	156	156	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	0	48	48	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	27	27	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	11	11	0 GBP	0.00	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
03/24	MSCI EMGMKT MAR24	0	80	80	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	NASDAQ 100 E-MINI MAR24	0	13	13	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	8	8	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	E-MINI RUSS 2000 MAR24	0	22	22	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	AUST 10Y BOND FUT MAR24	0	28	28	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	BCOM COMDTY IND MAR24	0	202	202	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	0	10	10	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	HANG SENG IDX FUT MAR24	0	11	11	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
03/24	CAN 10YR BOND FUT MAR24	0	25	25	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
04/24	HANG SENG IDX FUT APR24	0	11	0	11 HKD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	NIKKEI 225 (SGX) JUN24	0	14	18	-4 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	BCOM COMDTY IND JUN24	0	202	0	202 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	0	32	-32 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	SWISS MKT IX FUTR JUN24	0	18	0	18 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	0	14	-14 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	1	5	-4 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	MSCI EMGMKT JUN24	0	80	0	80 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	NASDAQ 100 E-MINI JUN24	0	13	7	6 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	CAN 10YR BOND FUT JUN24	0	0	25	-25 CAD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 02.11.2023	5'266'011	5'800'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 02.11.2023	20'293'000	1'740'997	NOK/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 02.11.2023	1'991'000	1'175'532	AUD/CHF	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023	3'854'132	3'463'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023	815'073	1'205'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	1'960'051	2'031'000	CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023	1'106'666	180'740'000	CHF/JPY	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 02.11.2023	360'575	2'893'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CHF/JPY	Verfall 04.12.2023	133'802'000	803'822	JPY/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 04.12.2023	1'641'000	1'068'275	CAD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.12.2023	4'764'347	5'299'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023	3'648'273	3'808'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 04.12.2023	3'179'061	2'904'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 04.12.2023	1'964'000	1'126'411	AUD/CHF	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 04.12.2023	365'122	2'972'000	CHF/CNY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024	3'633'434	3'808'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.01.2024	4'619'536	5'299'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024	3'208'784	2'904'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 04.01.2024	1'964'000	1'134'872	AUD/CHF	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 04.01.2024	1'641'000	1'052'066	CAD/CHF	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 04.01.2024	363'731	2'972'000	CHF/CNY	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 04.01.2024	1'000'820	168'146'000	CHF/JPY	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 04.01.2024	505'539	580'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 02.02.2024	21'003'000	1'731'508	NOK/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.02.2024	8'278'537	9'876'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 02.02.2024	1'210'235	203'287'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024	2'836'167	2'655'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024	1'538'823	1'657'000	CHF/EUR	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 02.02.2024	125'516	1'063'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CHF/CAD	Verfall 02.02.2024	2'207'000	1'398'033	CAD/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 02.02.2024	2'481'000	1'421'090	AUD/CHF	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 01.03.2024	578'825	902'000	CHF/CAD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 01.03.2024	3'756'540	4'030'000	CHF/EUR	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 01.03.2024	10'694'646	12'422'000	CHF/USD	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 01.03.2024	101'085	842'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 01.03.2024	21'808'000	1'791'920	NOK/CHF	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 01.03.2024	1'181'402	201'725'000	CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 01.03.2024	2'820'163	2'583'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 01.03.2024	2'456'000	1'391'931	AUD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.04.2024	10'902'591	12'422'000	CHF/USD	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 03.04.2024	1'180'541	201'725'000	CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024	3'832'687	4'030'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024	2'868'832	2'583'000	CHF/GBP	0.00	0.00
CNY/CHF	Verfall 03.04.2024	102'632	842'000	CHF/CNY	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 03.04.2024	21'808'000	1'809'083	NOK/CHF	0.00	0.00
CHF/AUD	Verfall 03.04.2024	2'456'000	1'403'459	AUD/CHF	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024	583'892	902'000	CHF/CAD	0.00	0.00
USD/JPY	Verfall 03.04.2024	531'814'000	3'610'292	JPY/USD	0.00	0.00
JPY/USD	Verfall 03.04.2024	3'583'527	531'814'000	USD/JPY	0.00	0.00
CHF/NOK	Verfall 02.05.2024	23'823'000	1'984'361	NOK/CHF	-12'113.95	-0.01 b)
CAD/CHF	Verfall 02.05.2024	688'458	1'037'000	CHF/CAD	468.56	0.00 b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.03.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 02.05.2024		4'256'895	3'743'000		CHF/GBP	13'365.11	0.01	b)
	USD/CHF Verfall 02.05.2024		9'621'419	10'652'000		CHF/USD	62'850.31	0.03	b)
	JPY/CHF Verfall 02.05.2024		1'389'810	232'021'000		CHF/JPY	6'918.37	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 02.05.2024		5'232'563	5'369'000		CHF/EUR	22'174.67	0.01	b)
	CHF/AUD Verfall 02.05.2024		2'751'000	1'613'838		AUD/CHF	-1'807.76	0.00	b)
	CNY/CHF Verfall 06.05.2024		327'913	2'635'000		CHF/CNY	1'907.13	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>93'762.44</b>	<b>0.04</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'066'990.78	2.34
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	124'695'655.38	57.58
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'012'828.79	0.93
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	82'755'124.79	38.21
Andere Anlagen - Metallkonten	935'404.11	0.43
Derivative Finanzinstrumente	93'762.44	0.04
Sonstige Vermögenswerte	1'019'601.59	0.47
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>216'579'367.88</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-262'844.19	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>216'316'523.69</b>	

## 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);	209'463'608.96	96.71
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	93'762.44	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

## Ausgeliehene Effekten

	Kurswert CHF	in % 7)
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>	<b>8'153'131.65</b>	<b>3.76</b>
CH0012549785 SONOVA HOLDING AG-REG	2'028 CHF 261.10	529'510.80 0.24
FR0000121014 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	84 EUR 833.70	68'122.58 0.03
US02079K1079 ALPHABET INC-CL C	4'259 USD 152.26	584'081.74 0.27
US1491231015 CATERPILLAR INC	1'545 USD 366.43	509'917.21 0.24
US22160K1051 COSTCO WHOLESALE CORP	111 USD 732.63	73'246.66 0.03
US4612021034 INTUIT INC	879 USD 650.00	514'614.95 0.24
US57636Q1040 MASTERCARD INC - A	1'370 USD 481.57	594'237.64 0.27
US5949181045 MICROSOFT CORP	11'284 USD 420.72	4'275'987.22 1.97
US7427181091 PROCTER & GAMBLE CO/THE	901 USD 162.25	131'670.86 0.06
US92826C8394 VISA INC-CLASS A SHARES	3'468 USD 279.08	871'741.99 0.40
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>	<b>2'012'828.79</b>	<b>0.93</b>
US91282CDX65 0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	2'300 USD 87.39%	2'012'828.79 0.93
<b>Andere Wertpapiere</b>	<b>253'974.60</b>	<b>0.12</b>
CH0009778769 IMMOFONDS	200 CHF 568.00	113'600.00 0.05
CH0026465366 UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDENTIAL	7'054 CHF 19.90	140'374.60 0.06

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

AED	1 = CHF	0.24527531
AUD	1 = CHF	0.58761668
CAD	1 = CHF	0.66558286
CNY	1 = CHF	0.12405653
CZK	100 = CHF	3.84700800
DKK	100 = CHF	13.04133800
EUR	1 = CHF	0.97275172
GBP	1 = CHF	1.13780928
HKD	100 = CHF	11.50841100
HUF	100 = CHF	0.24686700
JPY	100 = CHF	0.59513000
MXN	1 = CHF	0.05418804
NOK	100 = CHF	8.30245400
NZD	1 = CHF	0.53875371
PLN	1 = CHF	0.22586672
QAR	1 = CHF	0.24737709
SEK	100 = CHF	8.42358300
SGD	1 = CHF	0.66738293
TRY	1 = CHF	0.02784063
USD	1 = CHF	0.90070000
ZAR	1 = CHF	0.04756486

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	8'938'282.10	81.403
Bond	CHF	2'042'021.93	18.597
Total	CHF	10'980'304.03	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Engagement	Währung	Betrag	in % 29)
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	42'982'162.47	19.870
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	CHF	17'186'708.32	7.945
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	CHF	-	-

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

Periode: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
CT CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	8'153'131.65
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	2'012'828.79
Andere Wertpapiere	CHF	253'974.60

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 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: 01.10.2023 - 31.03.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	1.500	2.000	1.200	0.300	4.000
CT CHF	0.810	1.300	0.510	0.300	4.000
GT CHF	0.600	1.000	0.450	0.150	4.000
NT CHF	-	-	-	-	-

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.

## 9 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 10 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.

## 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.
- 4) Gemäss Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 23.02.2018 der Eidgenössischen Steuerverwaltung.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 29) Darstellung der Angaben in Prozent der Risikolimit (= Nettofondsvermögen \* Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimit zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100%.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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 Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
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 2% 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 jeweiligen Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des jeweiligen 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 Prospekt (Ziff. 1.8) 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 Prospekt 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 zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
  - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.