

SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE WORLD 45

Jahresbericht per 31.01.2024

Teilvermögens des Swisscanto (CH) Portfolio Fund II
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Effektenfonds»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	1559097	CHF
BA CHF	20594887	CHF
DT CHF	35899428	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Portfolio Fund II,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Switzerland 20
- ▶ Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible World 45

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



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 Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Januar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	17
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	17
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	18
8	Pauschale Verwaltungskommission	18
9	Benchmark	18
10	TER	18
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	19
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	19
13	Fussnoten	19
14	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20
15	Pflichtpublikationen	22

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	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		98'053'401.24	103'737'950.59	110'066'456.63	104'619'892.01
Klasse AA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		72'152'747.13	76'353'708.08	88'515'066.44	103'827'773.02
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		703'092.630	753'533.410	791'445.366	975'655.305
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		102.6220	101.3276	111.8398	106.4200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		102.4680	101.1148	111.7727	106.3500
Ausschüttung je Anteil		0.65	0.45	0.60	0.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.15 %	1.15 %	1.15 %	1.15 %
Klasse BA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'866'305.80	2'421'241.57	956'842.74	772'494.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		26'723.394	22'853.900	8'189.114	6'943.011
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		107.2583	105.9444	116.8433	111.2600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		107.0974	105.7219	116.7732	111.2000
Ausschüttung je Anteil		1.15	0.95	1.00	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.73 %	0.73 %	0.73 %	0.73 %
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'034'348.31	24'963'000.94	20'594'547.45	19'624.96
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		207'356.982	229'098.982	172'496.982	173.982
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.0855	108.9616	119.3908	112.8000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		110.9188	108.7328	119.3191	112.7300
Thesaurierung je Anteil		1.30	1.04	1.25	1.29
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %

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	1.79 %	4.48 %	-14.61 %	8.06 %
Klasse BA CHF	2.22 %	4.92 %	-14.25 %	8.51 %
Klasse DT CHF	2.29 %	5.01 %	-13.98 %	8.65 %

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)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	2'391'914.07	5'165'851.16
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	34'528'127.91	36'098'036.66
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	32'290'817.79	36'615'260.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	28'520'738.89	25'512'148.82
Derivative Finanzinstrumente	2'752.51	0.00
Sonstige Vermögenswerte	409'910.20	439'955.51
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	98'144'261.37	103'831'252.15
Andere Verbindlichkeiten	-90'860.13	-93'301.56
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	98'053'401.24	103'737'950.59

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		753'533.410	791'445.366
Ausgegebene Anteile		23'788.106	33'125.197
Zurückgenommene Anteile		-74'228.886	-71'037.153
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		703'092.630	753'533.410

Klasse BA CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'853.900	8'189.114
Ausgegebene Anteile		6'646.296	14'683.357
Zurückgenommene Anteile		-2'776.802	-18.571
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		26'723.394	22'853.900

Klasse DT CHF	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		229'098.982	172'496.982
Ausgegebene Anteile		30'060.000	86'190.000
Zurückgenommene Anteile		-51'802.000	-29'588.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		207'356.982	229'098.982

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		103'737'950.59	110'066'456.63
Ausbezahlte Ausschüttung		-358'683.82	-479'938.09
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-83'383.89	-91'548.48
Saldo aus dem Anteilverkehr		-6'982'133.79	4'104'166.62
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'739'652.15	-9'861'186.09
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		98'053'401.24	103'737'950.59

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		34'357.77	3'897.25
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'313.00	-15'281.77
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		793'906.07	903'974.32
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		416'465.98	625'532.02
Erträge der Gratisaktien		33.52	950.57
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		577'069.46	79'037.40
Erträge aus Wertpapierleihe		8'018.35	11'205.90
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		43'299.16	81'373.33
Total Ertrag		1'871'837.31	1'690'689.02
Aufwand			
Passivzinsen		-30.02	0.00
Reglementarische Vergütungen		-1'008'434.02	-1'068'614.83
Sonstige Aufwendungen		-1'106.59	-759.01
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-97'489.90	-56'021.05
Total Aufwand		-1'107'060.53	-1'125'394.89
Nettoertrag / Verlust		764'776.78	565'294.13
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-700'293.80	-984'838.95
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		27'247.54	38'260.08
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		20'977.66	23'344.93
Realisierter Erfolg		112'708.18	-357'939.81
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		1'626'943.97	-9'503'246.28
Gesamterfolg		1'739'652.15	-9'861'186.09

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	463'737.65	305'078.20
Vortrag des Vorjahres	3'169.51	37'181.34
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	466'907.16	342'259.54
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	457'010.21	339'090.03
Vortrag auf neue Rechnung	9'896.95	3'169.51
Total	466'907.16	342'259.54
Klasse BA CHF		
Nettoertrag	30'317.61	21'632.60
Vortrag des Vorjahres	803.98	882.59
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	31'121.59	22'515.19
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	30'731.91	21'711.21
Vortrag auf neue Rechnung	389.68	803.98
Total	31'121.59	22'515.19
Klasse DT CHF		
Nettoertrag	270'721.52	238'583.33
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	270'721.52	238'583.33
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	94'752.53	83'504.17
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	175'968.99	155'079.16
Total	270'721.52	238'583.33

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							67'128'110.84	68.40	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							34'528'127.91	35.18	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	45	178	223	0 USD	0.00	0.00	0.00	
AR							0.00	0.00	
AT0000746409	VERBUND AG	0	726	726	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT							0.00	0.00	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	4'923	3'908	2'745	6'086 AUD	44.50	153'581.05	0.16	a)
AU000000APA1	APA GROUP	6'114	0	6'114	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000BHP4	BHP GROUP LTD	2'030	1'304	3'334	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000COH5	COCHLEAR LTD	0	817	0	817 AUD	304.48	141'067.34	0.14	a)
AU000000MIN4	MINERAL RESOURCES LTD	519	435	954	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	9'076	5'033	1'529	12'580 AUD	15.85	113'072.13	0.12	a)
AU000000TLS2	TELSTRA GROUP LTD	10'772	32'750	43'522	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000WBC1	WESTPAC BANKING CORP	6'777	0	6'777	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	0	6'769	6'769	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU							407'720.52	0.42	
BE0003470755	SOLVAY SA	0	178	178	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003565737	KBC GROUP NV	456	1'066	1'197	325 EUR	60.48	18'316.21	0.02	a)
BE0003739530	UCB SA	0	209	209	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974264930	AGEAS	0	694	694	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE							18'316.21	0.02	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	28'873	0	28'873 USD	5.94	147'008.69	0.15	a)
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	0	58	58	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BM							147'008.69	0.15	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	2'960	13'556	15'052	1'464 CAD	20.88	19'627.28	0.02	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	1'602	0	1'602 CAD	27.95	28'749.68	0.03	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	2'716	0	2'716	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1'286	0	1'286	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3495531079	FORTIS INC	0	2'566	822	1'744 CAD	53.94	60'401.27	0.06	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	857	0	857	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	4'035	1'160	5'195	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	0	302	302	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	1'105	0	1'105	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA5503721063	LUNDIN MINING CORP	0	3'752	3'752	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	8'945	0	8'945 CAD	29.72	170'693.82	0.17	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	1'311	0	1'311	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	814	828	814	828 CAD	67.04	35'641.25	0.04	a)
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	1'805	2'888	2'794	1'899 CAD	58.63	71'488.06	0.07	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	0	5'830	0	5'830 CAD	39.19	146'700.79	0.15	a)
CA7677441056	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	0	327	327	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA87262K1057	TMX GROUP LTD	0	1'590	1'590	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	217	1'212	1'429	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA							533'302.15	0.54	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	0	442	34	408 CHF	516.20	210'609.60	0.21	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	66	105	50	121 CHF	3'609.00	436'689.00	0.44	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2'187	521	245	2'463 CHF	439.10	1'081'503.30	1.10	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	28'211	3'698	5'947	25'962 CHF	89.40	2'321'002.80	2.36	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9'456	2'056	1'560	9'952 CHF	247.10	2'459'139.20	2.51	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	4'865	633	1'140	4'358 CHF	66.16	288'325.28	0.29	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	21'164	3'539	7'685	17'018 CHF	36.69	624'390.42	0.64	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	1'059	625	868	816 CHF	277.70	226'603.20	0.23	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	1'462	142	180	1'424 CHF	424.80	604'915.20	0.62	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	254	556	64	746 CHF	621.40	463'564.40	0.47	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	402	82	45	439 CHF	1'173.00	514'947.00	0.52	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0	442	0	442 CHF	293.80	129'859.60	0.13	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6'014	0	6'014	0 CHF	0.00	0.00		
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	327	41	116	252 CHF	500.20	126'050.40	0.13	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	36'690	7'058	5'992	37'756 CHF	98.56	3'721'231.36	3.79	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	2'783	0	1'392	1'391 CHF	99.10	137'848.10	0.14	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	7'262	2'525	917	8'870 CHF	129.00	1'144'230.00	1.17	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	49'939	5'257	16'318	38'878 CHF	25.99	1'010'439.22	1.03	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	1'190	615	45	1'760 CHF	240.10	422'576.00	0.43	a)
CH0432492467	ALCON INC	8'553	3'911	2'131	10'333 CHF	65.44	676'191.52	0.69	a)
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	0	4'986	4'986	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH							16'600'115.60	16.91	
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	689	689	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	1'391	1'441	845	1'987 EUR	71.10	131'646.06	0.13	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	615	0	615	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	0	4'061	0	4'061 EUR	37.20	140'772.01	0.14	a)
DE0007164600	SAP SE	515	0	515	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	1'448	0	354	1'094 EUR	166.68	169'918.71	0.17	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	0	2'820	2'820	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	0	896	896	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE							442'336.78	0.45	
DK0060252690	PANDORA A/S	853	1'551	1'992	412 DKK	1'009.00	51'971.07	0.05	a)
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	0	825	825	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060738599	WILLIAM DEMANT HOLDING	1'255	0	1'255	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	2'251	1'650	601 DKK	774.80	58'215.33	0.06	a)
DK							110'186.40	0.11	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	0	1'717	268	1'449 EUR	65.06	87'846.17	0.09	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	8'093	0	8'093	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2'241	0	0	2'241 EUR	39.71	82'924.36	0.08	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	4'287	2'488	6'775	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES							170'770.53	0.17	
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	5'071	0	5'071	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	0	1'461	0	1'461 EUR	13.70	18'651.39	0.02	a)
FI0009013296	NESTE OYJ	0	416	416	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009014575	METSO OUTOTEC OYJ	0	2'542	2'542	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	13'752	0	13'752	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
FI							18'651.39	0.02	
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	0	165	165	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	6'440	0	1'034	5'406 EUR	31.16	156'968.99	0.16	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	79	30	109	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	0	1'142	1'142	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	6'695	4'422	4'860	6'257 EUR	23.96	139'699.02	0.14	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	3'092	438	890	2'640 EUR	62.55	153'876.26	0.16	a)
FR0000133308	ORANGE	0	4'317	0	4'317 EUR	11.00	44'242.15	0.05	a)
FR0010208488	ENGIE	2'407	0	2'407	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010307819	LEGRAND SA	0	343	343	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	0	10'554	10'554	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	0	624	0	624 EUR	30.82	17'920.81	0.02	a)
FR							512'707.23	0.52	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	938	0	938	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	4'327	0	0	4'327 GBP	598.80	28'304.92	0.03	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	18'222	12'184	2'947	27'459 GBP	618.20	185'441.52	0.19	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	3'139	0	3'139	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031348658	BARCLAYS PLC	83'614	0	83'614	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	4'623	551	5'174	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B033F229	CENTRICA PLC	0	41'967	0	41'967 GBP	138.45	63'473.75	0.06	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	3'176	800	3'976	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	0	2'068	2'068	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	0	976	278	698 USD	68.90	41'255.89	0.04	a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	0	47'520	0	47'520 GBP	286.60	148'780.45	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	47'049	0	2'908	44'141 GBP	225.20	108'593.49	0.11	a)
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	0	17'770	0	17'770 GBP	777.40	150'912.50	0.15	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	4'384	0	4'384	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE00BDB6Q211	WILLIS TOWERS WATSON PLC	200	0	200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	2'158	0	2'158	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00B8KF9B49	WPP PLC	0	2'589	2'589	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB							726'762.52	0.74	
BMG2178K1009	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	0	3'500	3'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	0	9'000	9'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	7'500	12'000	0	19'500 HKD	60.50	129'463.50	0.13	a)
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	11'000	0	11'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK							129'463.50	0.13	
IE0001827041	CRH PLC	0	546	0	546 GBP	5'624.00	33'545.26	0.03	a)
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	600	0	600	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	749	0	749 USD	252.05	161'949.60	0.17	a)
IE							195'494.86	0.20	
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	0	2'506	0	2'506 EUR	12.30	28'722.79	0.03	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	45'513	0	4'145	41'368 EUR	2.86	110'363.70	0.11	a)
IT0003128367	ENEL SPA	0	8'072	0	8'072 EUR	6.34	47'695.71	0.05	a)
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	4'213	0	4'213	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0004965148	MONCLER SPA	0	425	425	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT							186'782.20	0.19	
JP3119600009	AJINOMOTO CO INC	0	1'800	1'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3143600009	ITOCHU CORP	0	2'400	2'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3160400002	EISAI CO LTD	500	800	1'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164720009	RENESAS ELECTRONICS CORP	2'800	6'800	4'100	5'500 JPY	2'472.00	79'790.17	0.08	a)
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	2'700	1'100	400	3'400 JPY	7'691.00	153'461.68	0.16	a)
JP3165700000	NTT DATA GROUP CORP	0	1'400	1'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	1'200	4'800	6'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	6'000	0	6'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3228600007	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	0	2'000	2'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3258000003	KIRIN HOLDINGS CO LTD	2'600	0	2'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3283460008	KOEI TECMO HOLDINGS CO LTD	0	1'600	1'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3294460005	INPEX CORP	8'700	7'200	15'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3347200002	SHIONOGI & CO LTD	0	2'600	0	2'600 JPY	7'110.00	108'487.86	0.11	a)
JP3351100007	SYSMEX CORP	0	300	300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3371200001	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	0	3'700	3'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	9'100	36'800	45'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3409000001	SUMITOMO REALTY & DEVELOPMEN	2'200	0	2'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	2'400	3'000	5'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3496400007	KDDI CORP	1'900	0	1'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	0	100	0	100 JPY	27'865.00	16'352.99	0.02	a)
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	0	9'200	9'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3626800001	LIXIL CORP	3'300	0	3'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	1'500	4'100	3'400	2'200 JPY	12'310.00	158'934.78	0.16	a)
JP3726800000	JAPAN TOBACCO INC	0	1'000	1'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	1'500	0	1'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762800005	NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT	0	1'100	1'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	3'800	5'700	3'800	5'700 JPY	4'062.00	135'879.20	0.14	a)
JP3774200004	HANKYU HANSHIN HOLDINGS INC	0	900	900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3787000003	HITACHI CONSTRUCTION MACHINE	0	4'900	4'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	1'000	0	1'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	0	18'500	1'000	17'500 JPY	1'675.50	172'076.15	0.18	a)
JP3866800000	PANASONIC HOLDINGS CORP	0	13'800	0	13'800 JPY	1'408.50	114'070.71	0.12	a)
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	0	4'800	4'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3893200000	mitsui FUDOSAN CO LTD	2'700	6'500	2'700	6'500 JPY	3'728.00	142'209.13	0.14	a)
JP3899600005	mitsubishi ESTATE CO LTD	2'000	2'600	4'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3933800009	LY CORP	0	7'000	7'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	5'900	6'000	11'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942600002	YAMAHA CORP	1'700	0	1'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP3970300004	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	1'500	0	1'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP							1'081'262.67	1.10	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	0	39'043	32'888	6'155 EUR	3.15	18'055.24	0.02	a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	1'183	0	1'183	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	0	222	222	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0010273215	ASML HOLDING NV	215	0	215	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	800	0	800	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL							18'055.24	0.02	
NO0010096985	EQUINOR ASA	2'795	0	2'795	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010345853	AKER BP ASA	0	3'311	0	3'311 NOK	280.80	76'274.10	0.08	a)
NO							76'274.10	0.08	
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	18'684	0	18'684	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
NZ							0.00	0.00	
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	0	2'632	2'632	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PTJMTOAE0001	JERONIMO MARTINS	0	1'549	0	1'549 EUR	21.08	30'427.23	0.03	a)
PT							30'427.23	0.03	
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	0	7'391	649	6'742 SEK	256.40	143'522.17	0.15	a)
SE0000667925	TELIA CO AB	14'579	0	14'579	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B	0	2'563	0	2'563 SEK	244.70	52'070.87	0.05	a)
SE							195'593.04	0.20	
SG1R89002252	CITY DEVELOPMENTS LTD	9'600	0	9'600	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	7'600	6'700	3'200	11'100 SGD	12.89	91'847.44	0.09	a)
SG							91'847.44	0.09	
BMG491BT1088	INVESCO LTD	0	2'729	2'729	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BFBMT84	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	730	0	730	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	0	5'980	859	5'121 USD	28.39	124'718.69	0.13	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	432	684	1'116	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1'904	2'187	4'091	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	564	0	564	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	0	1'001	0	1'001 USD	94.12	80'821.58	0.08	a)
US00206R1023	AT&T INC	2'158	1'739	3'897	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00724F1012	ADOBE INC	391	107	86	412 USD	617.78	218'344.58	0.22	a)
US00751Y1064	ADVANCE AUTO PARTS INC	200	0	200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	1'171	0	1'171	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	353	0	353	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0126531013	ALBEMARLE CORP	0	78	78	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	786	0	786	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	5'570	740	6'310	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	4'504	1'635	1'057	5'082 USD	140.10	610'779.08	0.62	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	2'122	2'944	669	4'397 USD	155.20	585'409.19	0.60	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	0	718	0	718 USD	232.68	143'316.06	0.15	a)
US0311621009	AMGEN INC	0	1'069	330	739 USD	314.26	199'225.49	0.20	a)
US03662Q1058	ANSYS INC	0	460	460	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ANTHEM INC	128	0	128	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0378331005	APPLE INC	5'600	787	1'672	4'715 USD	184.40	745'854.25	0.76	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	1'072	604	1'676	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	420	145	565	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0404131064	ARISTA NETWORKS INC	437	0	437	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	0	728	0	728 USD	253.81	158'508.10	0.16	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	14	34	48	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	152	760	912	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	295	295	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05722G1004	BAKER HUGHES A GE CO	0	7'278	2'499	4'779 USD	28.50	116'840.46	0.12	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3'795	764	1'042	3'517 USD	55.46	167'326.06	0.17	a)
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	0	664	664	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	434	0	434	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09062X1037	BIOGEN INC	663	0	663	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	30	43	15	58 USD	3'507.47	174'515.22	0.18	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	3'975	401	4'376	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2'164	1'075	3'239	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	0	867	0	867 USD	204.20	151'874.96	0.15	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	137	142	105	174 USD	1'180.00	176'133.76	0.18	a)
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	1'732	237	1'969	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	143	412	143	412 USD	300.95	106'366.02	0.11	a)
US1266501006	CVS HEALTH CORP	607	0	607	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	0	5'648	0	5'648 USD	24.88	120'547.00	0.12	a)
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	1'062	0	381	681 USD	288.46	168'517.13	0.17	a)
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	2'079	1'720	3'799	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	940	0	940	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	394	1'632	484	1'542 USD	109.19	144'437.05	0.15	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	3'175	0	3'175	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1491231015	CATERPILLAR INC	863	647	748	762 USD	300.31	196'307.15	0.20	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	402	129	531	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	2'195	1'117	1'078 USD	163.99	151'651.77	0.15	a)
US1667641005	CHEVRON CORP	0	1'246	1'246	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	39	50	9	80 USD	2'408.77	165'309.07	0.17	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	1'281	0	1'281	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	5'389	0	5'389	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1729081059	CINTAS CORP	328	0	328	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	146	0	146 USD	145.25	18'192.00	0.02	a)
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	3'616	0	3'616	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	3'452	2'524	966	5'010 USD	46.54	200'020.94	0.20	a)
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	0	2'500	2'500	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	1'949	0	1'949	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	2'001	204	359	1'846 USD	90.90	143'948.43	0.15	a)
US2166484020	COOPER COS INC/THE	0	74	74	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22052L1044	CORTEVA INC	3'086	0	3'086	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22160N1090	COSTAR GROUP INC	0	716	716	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2310211063	CUMMINS INC	769	0	769	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US23804L1035	DATADOG INC - CLASS A	0	299	299	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2441991054	DEERE & CO	266	0	266	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	1'783	1'783	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2521311074	DEXCOM INC	0	1'427	1'427	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	0	1'126	0	1'126 USD	153.74	148'503.48	0.15	a)
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	0	1'682	0	1'682 USD	105.52	152'255.20	0.16	a)
US2600031080	DOVER CORP	855	0	855	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	7'627	0	1'830	5'797 USD	31.68	157'543.26	0.16	a)
US26614N1028	DUPONT DE NEMOURS INC	537	1'531	2'068	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26875P1012	EOG RESOURCES INC	1'540	0	1'540	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26884L1098	EQT CORP	0	1'909	1'909	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	1'585	2'270	3'855	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2788651006	ECOLAB INC	0	1'017	100	917 USD	198.22	155'929.46	0.16	a)
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1'242	532	1'774	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	536	966	1'502	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	0	1'972	0	1'972 USD	91.73	155'177.82	0.16	a)
US3021301094	EXPEDITORS INTL WASH INC	0	249	249	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	2'458	614	3'072	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3024913036	FMC CORP	1'221	0	1'221	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	0	362	0	362 USD	390.14	121'154.74	0.12	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	0	652	0	652 USD	241.29	134'957.89	0.14	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	490	0	490	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	0	3'313	3'313	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959E1091	FORTINET INC	709	474	1'183	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	1'247	0	1'247	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	5'217	5'217	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US36266G1076	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	0	366	366	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3666511072	GARTNER INC	440	0	440	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	1'352	1'352	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	2'539	3'236	2'929	2'846 USD	64.91	158'473.94	0.16	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	2'632	254	2'886	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	2'200	0	1'235	965 USD	106.66	88'295.84	0.09	a)
US3848021040	VW GRAINGER INC	0	79	0	79 USD	895.64	60'697.66	0.06	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	787	0	787	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	830	0	830	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4180561072	HASBRO INC	2'808	0	2'808	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4364401012	HOLOGIC INC	0	1'983	1'983	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4404521001	HORMEL FOODS CORP	0	719	719	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	149	0	149	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45167R1041	IDEX CORP	143	0	143	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45337C1027	INCYTE CORP	0	2'723	0	2'723 USD	58.77	137'282.34	0.14	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	2'334	0	2'334 USD	79.86	159'897.44	0.16	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	628	0	628	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	0	1'735	1'735	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4606901001	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2'143	0	2'143	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4612021034	INTUIT INC	0	360	0	360 USD	631.33	194'971.12	0.20	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	0	161	161	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	0	280	143	137 USD	174.36	20'491.74	0.02	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	1'095	0	1'095	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4824801009	KLA CORP	183	0	183	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	5'760	0	5'760 USD	31.44	155'351.83	0.16	a)
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1'051	0	1'051	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	0	1'609	152	1'457 USD	120.97	151'198.88	0.15	a)
US5010441013	KROGER CO	1'182	934	2'116	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5018892084	LKQ CORP	2'996	0	2'996	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5218652049	LEAR CORP	0	1'253	0	1'253 USD	132.90	142'852.36	0.15	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	415	307	400	322 USD	645.61	178'335.37	0.18	a)
US5341871094	LINCOLN NATIONAL CORP	2'294	2'029	4'323	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5502411037	LUMEN TECHNOLOGIES INC	24'728	0	24'728	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	0	4'219	4'219	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	0	2'633	2'633	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	316	434	116	634 USD	449.23	244'325.82	0.25	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	239	0	239	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	2'319	287	2'078	528 USD	120.78	54'706.67	0.06	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	2'299	999	741	2'557 USD	397.58	872'100.66	0.89	a)
US60770K1079	MODERNA INC	874	0	874	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	0	2'760	0	2'760 USD	61.79	146'298.08	0.15	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	0	385	385	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	0	705	0	705 USD	139.77	84'530.69	0.09	a)
US65473P1057	NISOURCE INC	0	3'857	0	3'857 USD	25.97	85'927.65	0.09	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	170	1'210	198	1'182 USD	615.27	623'870.67	0.64	a)
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	1'706	0	1'706	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68389X1054	ORACLE CORP	467	0	467	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	0	1'288	114	1'174 USD	151.53	152'608.27	0.16	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	0	1'362	1'362	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	0	1'278	0	1'278 USD	141.04	154'626.71	0.16	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	0	666	62	604 USD	338.51	175'396.05	0.18	a)
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	0	2'560	1'913	647 USD	61.35	34'051.03	0.03	a)
US7170811035	PFIZER INC	4'404	0	4'404	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	0	1'377	587	790 USD	144.31	97'799.10	0.10	a)
US71880K1016	PHINIA INC	0	662	662	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72352L1061	PINTEREST INC- CLASS A	5'253	0	5'253	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	1'429	637	2'066	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7458671010	PULTEGROUP INC	666	1'094	556	1'204 USD	104.56	107'994.94	0.11	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	61	178	32	207 USD	942.78	167'414.11	0.17	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	1'226	594	1'820	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7595091023	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	0	422	422	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	0	1'015	0	1'015 USD	281.09	244'750.05	0.25	a)
US81762P1021	SERVICENOW INC	0	379	77	302 USD	765.40	198'292.71	0.20	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	0	415	0	415 USD	304.38	108'361.64	0.11	a)
US82968B1035	SIRIUS XM HOLDINGS INC	0	10'376	10'376	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8330341012	SNAP-ON INC	115	0	0	115 USD	289.93	28'602.39	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US8716071076	SYNOPSIS INC	557	0	207	350 USD	533.35	160'137.00	0.16	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	1'008	299	1'307	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8718291078	SYSCO CORP	0	2'617	375	2'242 USD	80.93	155'652.64	0.16	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	412	0	412	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88160R1014	TESLA INC	680	260	825	115 USD	187.29	18'476.67	0.02	a)
US88579Y1010	3M CO	1'782	173	1'955	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	414	0	414	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	0	4'152	904	3'248 USD	65.27	181'861.59	0.19	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	73	67	140	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113631090	UNITED RENTALS INC	437	119	252	304 USD	625.40	163'095.81	0.17	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	683	427	641	469 USD	511.74	205'889.20	0.21	a)
US9182041080	VF CORP	0	4'167	4'167	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	0	1'298	1'298	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343E1029	VERISIGN INC	341	0	341	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3'453	5'503	3'453	5'503 USD	42.35	199'923.70	0.20	a)
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	245	329	113	461 USD	433.38	171'388.29	0.17	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	1'258	186	247	1'197 USD	273.26	280'596.06	0.29	a)
US9633201069	WHIRLPOOL CORP	0	211	211	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	0	800	103	697 USD	291.07	174'037.00	0.18	a)
US98419M1009	XYLEM INC	933	864	1'797	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9884981013	YUM! BRANDS INC	860	0	860	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9892071054	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	234	0	234	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	0	3'472	3'472	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	1'385	1'385	0 USD	0.00	0.00	0.00	

US

12'835'049.61 13.08

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

32'290'817.79 32.90

CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	500	0	300	200 CHF	113.08%	226'160.00	0.23	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	200	0	0	200 CHF	123.63%	247'260.00	0.25	a)
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	700	0	0	700 CHF	109.70%	767'900.00	0.78	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	1'000	0	500	500 CHF	101.49%	507'450.00	0.52	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	500	0	0	500 CHF	113.60%	568'000.00	0.58	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	600	0	0	600 CHF	102.30%	613'800.00	0.63	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	700	0	0	700 CHF	114.30%	800'100.00	0.82	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	500	0	0	500 CHF	121.90%	609'500.00	0.62	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	1'000	0	0	1'000 CHF	106.32%	1'063'200.00	1.08	a)
CH0116712644	2.0000 % RAIFFS 2 09/21/23	400	0	400	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	1'000	0	0	1'000 CHF	107.35%	1'073'500.00	1.09	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	400	0	0	400 CHF	104.64%	418'560.00	0.43	a)
CH0131610740	2.2500 % PFZENT 2 1/4 06/16/23 411	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	1'000	0	0	1'000 CHF	100.00%	1'000'000.00	1.02	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	1'000	0	0	1'000 CHF	99.95%	999'500.00	1.02	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	1'000	0	700	300 CHF	99.58%	298'740.00	0.30	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	1'000	0	500	500 CHF	99.00%	495'000.00	0.50	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'000	0	0	1'000 CHF	100.20%	1'002'000.00	1.02	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'000	0	0	1'000 CHF	99.80%	998'000.00	1.02	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'000	0	0	1'000 CHF	101.45%	1'014'500.00	1.03	a)
CH0217579777	1.3750 % EGW 1 3/8 07/24/23 46	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	1'500	0	500	1'000 CHF	96.55%	965'500.00	0.98	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	1'500	0	1'300	200 CHF	98.77%	197'540.00	0.20	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	1'000	0	0	1'000 CHF	97.20%	972'000.00	0.99	a)
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	1'000	0	0	1'000 CHF	92.26%	922'600.00	0.94	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	1'000	0	0	1'000 CHF	98.67%	986'700.00	1.01	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	1'500	0	1'200	300 CHF	98.08%	294'240.00	0.30	a)
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	1'000	0	1'000	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	200	0	0	200 CHF	95.70%	191'400.00	0.20	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	200	0	0	200 CHF	78.68%	157'360.00	0.16	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	900	0	0	900 CHF	95.33%	857'970.00	0.87	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	800	0	400	400 CHF	98.92%	395'680.00	0.40	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	1'000	0	0	1'000 CHF	77.50%	775'000.00	0.79	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	1'000	0	0	1'000 CHF	91.77%	917'700.00	0.94	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	200	0	0	200 CHF	95.72%	191'440.00	0.20	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	200	0	0	200 CHF	91.55%	183'100.00	0.19	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	500	0	0	500 CHF	101.65%	508'250.00	0.52	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	200	0	0	200 CHF	100.40%	200'800.00	0.20	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	200	200	0	400 CHF	72.60%	290'400.00	0.30	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	600	0	0	600 CHF	89.65%	537'900.00	0.55	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	800	0	0	800 CHF	87.35%	698'800.00	0.71	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	500	0	0	500 CHF	83.50%	417'500.00	0.43	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	400	0	0	400 CHF	91.39%	365'560.00	0.37	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	700	0	0	700 CHF	94.78%	663'460.00	0.68	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBSNW 0.1 04/18/31	400	0	0	400 CHF	90.30%	361'200.00	0.37	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	900	0	500	400 CHF	88.90%	355'600.00	0.36	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	1'000	0	230	770 CHF	89.37%	688'149.00	0.70	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	600	0	0	600 CHF	89.00%	534'000.00	0.54	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	200	0	0	200 CHF	95.05%	190'100.00	0.19	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	600	0	0	600 CHF	99.11%	594'660.00	0.61	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	400	0	0	400 CHF	99.32%	397'280.00	0.40	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	400	0	0	400 CHF	92.57%	370'280.00	0.38	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	200	0	0	200 CHF	98.60%	197'200.00	0.20	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	500	0	0	500 CHF	97.85%	489'250.00	0.50	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	400	0	0	400 CHF	98.85%	395'400.00	0.40	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	200	0	0	200 CHF	101.55%	203'100.00	0.21	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	100	0	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	400	0	200	200 CHF	98.75%	197'500.00	0.20	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	500	0	500 CHF	102.30%	511'500.00	0.52	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	200	0	200 CHF	106.15%	212'300.00	0.22	a)
CH1255924438	2.0000 % PSHYPO 2 04/02/38 739	0	200	0	200 CHF	106.45%	212'900.00	0.22	a)
CH1305916780	1.9500 % ROSW 1.95 09/15/38	0	300	0	300 CHF	105.90%	317'700.00	0.32	a)
CH1306117156	1.3000 % ZURCTY 1.3 01/26/47	0	500	0	500 CHF	98.80%	494'000.00	0.50	a)
CH1321481470	1.7150 % UBS 1.715 01/24/34	0	500	0	500 CHF	100.30%	501'500.00	0.51	a)
CHF							31'617'689.00	32.22	
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	0	800	0	800 USD	98.08%	673'128.79	0.69	a)
USD							673'128.79	0.69	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
GB00BMX3XR77	SHELL PLC-EEE AUG23	0	4'113	4'113	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	3'560	3'560	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	0	4'384	4'384	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XV14	SHELL PLC-EEE MAY23	0	4'113	4'113	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	998	998	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LH9	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	998	998	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							309'165.14	0.32	
IE00BJ5JP105	ISHARES MSCI WD ENERGY-USD D	0	54'177	0	54'177 EUR	6.12	309'165.14	0.32	a)
DE							309'165.14	0.32	
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							28'211'573.75	28.75	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							28'211'573.75	28.75	
CH0030098732	SWC (CH) BF RESPONSIBLE GLOBAL RATES NT CHF	0	427	427	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0117045192	SWC (CH) INDEX BF USA GOVT. NT USD	0	5'000	5'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	22'095	0	0	22'095 USD	130.53	2'474'043.78	2.52	a)
CH0192251772	SWC (CH) EF RESP SMC SWITZERLAND (I) NT CHF	17'430	2'523	741	19'212 CHF	221.01	4'246'075.50	4.33	a)
CH0215804375	SWC (CH) INDEX BF AUSTRALIA GOVT. NT	0	2'972	2'972	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
CH0215804458	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. NT GBP	0	1'958	1'958	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
CH0394628066	SWC (CH) MMF RESPONSIBLE OPPS CHF NT CHF	0	15'682	5'839	9'843 CHF	96.19	946'804.15	0.96	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0492410698	SWC (CH) BF RESPONSIBLE GLOBAL RATES NTH1 CHF	46'874	20'799	0	67'673 CHF	86.26	5'837'795.18	5.95	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS. GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	103'379	0	0	103'379 CHF	87.11	9'005'716.85	9.18	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	45'073	10'841	10'314	45'600 CHF	83.19	3'793'623.60	3.87	a)
CH0595708501	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NTH1 CHF	14'741	0	0	14'741 CHF	88.82	1'309'279.40	1.33	a)
CH							27'613'338.46	28.14	
0U1637934826	SWC (LU) MMF RESPONSIBLE USD NT	4'000	0	4'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
LU1637934826	SWC (LU) MMF RESPONSIBLE USD NT	0	6'018	0	6'018 USD	115.88	598'235.29	0.61	a)
LU							598'235.29	0.61	

Nicht kotierte Wertpapiere

0.00 0.00

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte

0.00 0.00

CRH ID	CRH PLC	0	546	546	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
--------	---------	---	-----	-----	-------	------	------	------	--

IE 0.00 0.00

Derivative Finanzinstrumente

2'752.51 0.00

Futures

0.00 0.00

03/23	AUST 10Y BOND FUT MAR23	0	14	14	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	SPI 200 FUTURES MAR23	6	0	6	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	22	0	22	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	SWISS MKT IX FUTR MAR23	-10	10	0	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P500 EMINI FUT MAR23	5	0	5	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	FTSE 100 IDX FUT MAR23	10	0	10	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	AUST 10Y BOND FUT JUN23	0	14	14	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	15	15	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MKT IX FUTR JUN23	0	14	14	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	13	13	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	NASDAQ 100 E-MINI JUN23	0	2	2	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MKT IX FUTR SEP23	0	3	3	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
09/23	NASDAQ 100 E-MINI SEP23	0	2	2	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	E-MINI RUSS 2000 SEP23	0	6	6	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SWISS MKT IX FUTR DEC23	0	6	6	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
12/23	NASDAQ 100 E-MINI DEC23	0	4	4	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	E-MINI RUSS 2000 DEC23	0	3	3	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	0	4	9	-5 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	NASDAQ 100 E-MINI MAR24	0	9	2	7 USD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

EUR/CHF	Verfall 01.03.2024	316'295	339'000	CHF/EUR	993.06	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 01.03.2024	389'175	453'000	CHF/USD	1'759.45	0.00	b)

Devisentermingeschäfte

2'752.51 0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	2'391'914.07	2.44
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	34'528'127.91	35.18
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	32'290'817.79	32.90
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	28'520'738.89	29.06
Derivative Finanzinstrumente	2'752.51	0.00
Sonstige Vermögenswerte	409'910.20	0.42
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	98'144'261.37	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-90'860.13	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	98'053'401.24	

Bewertungskategorien

Kurswert
CHF in %
7)

		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);	95'339'684.59	97.14
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	2'752.51	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

Ausgeliehene Effekten

		8'946'650.25	9.12
--	--	--------------	------

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte

				4'870'300.25	4.96	
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	120	CHF	3'609.00	433'080.00	0.44
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	632	CHF	277.70	175'506.40	0.18
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	355	CHF	293.80	104'299.00	0.11
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	210	CHF	500.20	105'042.00	0.11
CH0126881561	SWISS RE AG	1'390	CHF	99.10	137'749.00	0.14
FR0000131104	BNP PARIBAS	2'640	EUR	62.55	153'876.26	0.16
US00724F1012	ADOBE INC	412	USD	617.78	218'344.58	0.22
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	5'082	USD	140.10	610'779.08	0.62
US0231351067	AMAZON.COM INC	4'119	USD	155.20	548'396.74	0.56
US0311621009	AMGEN INC	739	USD	314.26	199'225.49	0.20
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	681	USD	288.46	168'517.13	0.17
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	80	USD	2'408.77	165'309.07	0.17
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	137	USD	174.36	20'491.74	0.02
US5324571083	ELI LILLY & CO	322	USD	645.61	178'335.37	0.18
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	528	USD	120.78	54'706.67	0.06
US5949181045	MICROSOFT CORP	2'437	USD	397.58	831'172.98	0.85
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	604	USD	338.51	175'396.05	0.18
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	207	USD	942.78	167'414.11	0.17
US81762P1021	SERVICENOW INC	302	USD	765.40	198'292.71	0.20
US88160R1014	TESLA INC	115	USD	187.29	18'476.67	0.02
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	469	USD	511.74	205'889.20	0.21

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte

				4'076'350.00	4.15	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	200	CHF	123.63%	247'260.00	0.25
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	500	CHF	121.90%	609'500.00	0.62
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	400	CHF	104.64%	418'560.00	0.43
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	500	CHF	100.00%	500'000.00	0.51
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	500	CHF	77.50%	387'500.00	0.39
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	500	CHF	94.78%	473'900.00	0.48
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	400	CHF	88.90%	355'600.00	0.36
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	400	CHF	99.32%	397'280.00	0.40
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	500	CHF	97.85%	489'250.00	0.50
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	200	CHF	98.75%	197'500.00	0.20

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56708174
CAD	1 = CHF	0.64207926
DKK	100 = CHF	12.50182200
EUR	1 = CHF	0.93183793
GBP	1 = CHF	1.09242908
HKD	100 = CHF	10.97380800
JPY	100 = CHF	0.58686500
NOK	100 = CHF	8.20390900
SEK	100 = CHF	8.30256400
SGD	1 = CHF	0.64193512
USD	1 = CHF	0.85785000

4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	8'275'800.50	86.734
Bond	CHF	1'265'787.82	13.266
Total	CHF	9'541'588.32	100.000

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

5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	2'058'165.39	2.099
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	1'271'168.11	1.296

6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-

7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	4'870'300.25
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	4'076'350.00
Andere Wertpapiere	CHF	-

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: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	1.150	2.000	0.850	0.300	4.000
BA CHF	0.730	1.500	0.430	0.300	4.000
DT CHF	0.600	1.200	0.450	0.150	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.

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 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	0.65000	0.22750	0.42250
BA CHF	Nein	CHF	1.15000	0.40250	0.74750

12 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 07.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 10.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	1.305	0.456	0.849

13 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.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 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.

14 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 gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Da-bei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des ein-bezahlten 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 einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile 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 zu-zurechnen sind, werden erst-mals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Portfolio Fund II

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Effektenfonds"
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Switzerland 20

Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible World 45

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, die Anlagepolitik im Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Die Anlagepolitik der jeweiligen Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 2 Bst. aa und § 8 Ziff. 3 Bst. aa des Fondsvertrages präzisiert werden.

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

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible World 45 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Wandelobligationen, Wandelnotes, Optionsanleihen und Notes sowie andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und -rechte) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldern (inkl. Contingent Convertible Bonds, Bail-in Bonds, Asset Backed Securities und Mortgage Backed Securities) zu den zulässigen Anlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 2 Bst. aa des Fondsvertrages).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Portfolio Fund Responsible Switzerland 20 ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen in Schweizer Franken inkl. Bail-in-Bonds) von privaten und öffentlich-rechtlichen in- und ausländischen Schuldern mit einem Mindestrating von A (Standard & Poor's), A2 (Moody's) oder einem gleichwertigen Rating einer anderen anerkannten Ratingagentur zu den zulässigen Anlagen gehören. Zudem gilt, dass bei Fehlen eines offiziellen Ratings ein Bankenrating herangezogen werden kann (vgl. § 8 Ziff. 3 Bst. aa des Fondsvertrages).

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

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

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

Zürich, 14. April 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich