

# SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND EMU

## Jahresbericht per 30.09.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
FA EUR	46141386	EUR
GT EUR	46141387	EUR
MT EUR	51786308	EUR
NT EUR	46141388	EUR

Rechnungswährung: EUR

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

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund III,

mit den Teilvermögen

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

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

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



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

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



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen**

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

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

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte 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 30. September 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

## Inhaltsverzeichnis

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

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### 3 Abschlusszahlen

#### Übersicht

	von	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		85'380'269.69	61'924'450.31	80'905'514.01	68'559'993.45
<b>Klasse FA EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		17'947'984.70	10'520'150.64	14'077'520.55	11'023'137.82
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		147'195.550	104'555.909	112'955.740	113'687.936
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		121.9329	100.6175	124.6286	96.9596
Ausschüttung je Anteil		3.05	3.25	2.00	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.17 %	0.17 %	0.18 %	0.16 %
<b>Klasse GT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		873'576.36	883'836.05	3'603'847.45	9'539'979.09
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'769.136	8'451.080	28'113.621	96'548.077
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		129.0529	104.5826	128.1887	98.8107
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		124.9934	100.8410	138.5882	106.4558
Thesaurierung je Anteil		3.30	3.30	2.09	1.75
Total Expense Ratio (TER)		0.11 %	0.11 %	0.16 %	0.14 %
<b>Klasse MT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'736'529.68	3'620'608.78	4'435'257.10	192'727.66
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		41'252.837	38'952.837	38'952.837	2'200.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		114.8171	92.9485	113.8622	87.6035
Thesaurierung je Anteil		3.05	3.04	2.00	1.39
Total Expense Ratio (TER)		0.01 %	0.01 %	0.02 %	0.00 %
<b>Klasse NT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		61'822'178.95	46'899'854.84	58'788'888.91	47'804'148.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		476'974.643	446'966.984	457'363.888	482'928.102
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		129.6131	104.9291	128.5385	98.9881
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		125.5361	101.1751	138.9664	106.6470
Thesaurierung je Anteil		3.44	3.43	2.26	1.90
Total Expense Ratio (TER)		0.01 %	0.01 %	0.02 %	0.00 %

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



## Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DA EUR (Schliessung 17.07.2020)	-	-	-	-9.10 %
Klasse DT EUR (Schliessung 17.07.2020)	-	-	-	-9.10 %
Klasse FA EUR	24.44 %	-12.47 %	22.13 %	-1.10 %
Klasse GT EUR	24.51 %	-12.42 %	22.17 %	-1.08 %
Klasse MT EUR (Lancierung 28.01.2020)	24.68 %	-12.34 %	22.32 %	-1.15 %
Klasse NT EUR	24.68 %	-12.34 %	22.33 %	-0.94 %
Benchmark	24.25 %	-12.47 %	22.16 %	-1.02 %
Tracking Error 33)	0.51 %	0.12 %	0.06 %	0.16 %

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

## Tracking Differenz

### Klasse

Klasse FA EUR	0.19 %
Klasse GT EUR	0.26 %
Klasse MT EUR (Lancierung 28.01.2020)	0.43 %
Klasse NT EUR	0.43 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	740'518.61	507'189.52
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	84'607'158.33	61'647'997.63
Sonstige Vermögenswerte	34'961.07	34'755.31
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>85'382'638.01</b>	<b>62'189'942.46</b>
Andere Verbindlichkeiten	-2'368.32	-265'492.15
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>85'380'269.69</b>	<b>61'924'450.31</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Klasse FA EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		104'555.909	112'955.740
Ausgegebene Anteile		49'377.836	8'440.262
Zurückgenommene Anteile		-6'738.195	-16'840.093
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>147'195.550</b>	<b>104'555.909</b>
<b>Klasse GT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		8'451.080	28'113.621
Ausgegebene Anteile		1'326.325	-
Zurückgenommene Anteile		-3'008.269	-19'662.541
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>6'769.136</b>	<b>8'451.080</b>
<b>Klasse MT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		38'952.837	38'952.837
Ausgegebene Anteile		2'300.000	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>41'252.837</b>	<b>38'952.837</b>
<b>Klasse NT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		446'966.984	457'363.888
Ausgegebene Anteile		122'504.084	140'909.806
Zurückgenommene Anteile		-92'496.425	-151'306.710
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>476'974.643</b>	<b>446'966.984</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		61'924'450.31	80'905'514.01
Ausbezahlte Ausschüttung		-335'566.49	-222'592.97
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-663'568.35	-468'329.84
Saldo aus dem Anteilverkehr		8'771'501.93	-3'193'503.64
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		15'683'452.29	-15'096'637.25
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>85'380'269.69</b>	<b>61'924'450.31</b>

## Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Konsolidiert</b>			
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		7'615.58	86.13
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-3'071.70
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		2'093'179.76	1'895'109.68
Erträge der Gratisaktien		49'133.75	346'646.93
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		214'117.33	136'189.25
<b>Total Ertrag</b>		<b>2'364'046.42</b>	<b>2'374'960.29</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-0.34	-32.21
Reglementarische Vergütungen		-23'348.16	-21'955.54
Sonstige Aufwendungen		-5'678.28	-5'313.75
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-93'716.00	-338'525.89
<b>Total Aufwand</b>		<b>-122'742.78</b>	<b>-365'827.39</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>2'241'303.64</b>	<b>2'009'132.90</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		1'084'612.30	1'151'183.53
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		62'121.14	30'247.47
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		44'057.65	39'081.64
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>3'432'094.73</b>	<b>3'229'645.54</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		12'251'357.56	-18'326'282.79
<b>Gesamterfolg</b>		<b>15'683'452.29</b>	<b>-15'096'637.25</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse FA EUR	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	450'497.40	325'005.69
Vortrag des Vorjahres	1'141.48	15'942.49
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>451'638.88</b>	<b>340'948.18</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	448'946.42	339'806.70
Vortrag auf neue Rechnung	2'692.46	1'141.48
<b>Total</b>	<b>451'638.88</b>	<b>340'948.18</b>
<b>Klasse GT EUR</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	22'367.59	27'952.30
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>22'367.59</b>	<b>27'952.30</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	7'828.66	9'783.31
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	14'538.93	18'169.00
Vortrag auf neue Rechnung	0.00	-0.01
<b>Total</b>	<b>22'367.59</b>	<b>27'952.30</b>
<b>Klasse MT EUR</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	125'844.79	118'691.93
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>125'844.79</b>	<b>118'691.93</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	44'045.68	41'542.18
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	81'799.11	77'149.75
<b>Total</b>	<b>125'844.79</b>	<b>118'691.93</b>
<b>Klasse NT EUR</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	1'642'593.86	1'537'482.98
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>1'642'593.86</b>	<b>1'537'482.98</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	574'907.85	538'119.04
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'067'686.01	999'363.94
<b>Total</b>	<b>1'642'593.86</b>	<b>1'537'482.98</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>84'607'158.33</b>	<b>99.09</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>84'607'158.33</b>	<b>99.09</b>	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	5'174	1'899	504	6'569 EUR	32.82	215'594.58	0.25	a)
AT0000743059	OMV AG	2'260	736	378	2'618 EUR	45.32	118'647.76	0.14	a)
AT0000746409	VERBUND AG	1'120	86	0	1'206 EUR	77.05	92'922.30	0.11	a)
AT0000937503	VOESTALPINE AG	2'065	0	0	2'065 EUR	25.84	53'359.60	0.06	a)
BE0003470755	SOLVAY SA	1'261	199	148	1'312 EUR	104.85	137'563.20	0.16	a)
BE0003565737	KBC GROUP NV	4'187	1'172	623	4'736 EUR	59.14	280'087.04	0.33	a)
BE0003604155	LOTUS BAKERIES	0	8	0	8 EUR	7'690.00	61'520.00	0.07	a)
BE0003717312	SOFINA	255	18	0	273 EUR	191.80	52'361.40	0.06	a)
BE0003739530	UCB SA	2'045	595	183	2'457 EUR	77.54	190'515.78	0.22	a)
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	1'408	563	201	1'770 EUR	70.56	124'891.20	0.15	a)
BE0003810273	PROXIMUS	1'037	0	1'037	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003822393	ELIA GROUP SA/NV	580	6	0	586 EUR	92.65	54'292.90	0.06	a)
BE0974259880	D'IETEREN GROUP	441	0	0	441 EUR	159.90	70'515.90	0.08	a)
BE0974264930	AGEAS	2'720	139	0	2'859 EUR	39.03	111'586.77	0.13	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14'034	3'710	1'618	16'126 EUR	52.51	846'776.26	0.99	a)
BE0974320526	UMICORE	3'297	973	554	3'716 EUR	22.45	83'424.20	0.10	a)
BE0974349814	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2'040	903	0	2'943 EUR	23.44	68'983.92	0.08	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	3'857	317	3'540 EUR	80.13	283'660.20	0.33	a)
CRH ID	CRH PLC	12'382	2'448	14'830	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1'645	68	1'713	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	32'727	8'832	5'249	36'310 EUR	10.45	379'439.50	0.44	a)
DE0005158703	BECHTLE AG	1'455	0	0	1'455 EUR	44.24	64'369.20	0.08	a)
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5'416	1'380	1'120	5'676 EUR	96.38	547'052.88	0.64	a)
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	927	313	196	1'044 EUR	88.30	92'185.20	0.11	a)
DE0005200000	BEIERSDORF AG	1'673	425	309	1'789 EUR	122.15	218'526.35	0.26	a)
DE0005313704	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	569	144	0	713 EUR	82.82	59'050.66	0.07	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	1'629	566	250	1'945 EUR	66.76	129'848.20	0.15	a)
DE0005552004	DHL GROUP	16'091	4'588	2'043	18'636 EUR	38.54	718'138.26	0.84	a)
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	52'432	12'717	5'114	60'035 EUR	19.87	1'192'775.38	1.40	a)
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	7'038	1'626	629	8'035 EUR	29.46	236'711.10	0.28	a)
DE0005785802	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3'181	863	379	3'665 EUR	40.84	149'678.60	0.18	a)
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	3'048	826	319	3'555 EUR	163.70	581'953.50	0.68	a)
DE0006047004	HEIDELBERG MATERIALS AG	2'174	818	232	2'760 EUR	73.52	202'915.20	0.24	a)
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	1'575	519	261	1'833 EUR	59.72	109'466.76	0.13	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	2'919	345	101	3'163 EUR	67.46	213'375.98	0.25	a)
DE0006062144	COVESTRO AG	3'349	1'388	1'034	3'703 EUR	51.06	189'075.18	0.22	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	21'164	5'724	2'656	24'232 EUR	31.36	759'794.36	0.89	a)
DE0006452907	NEMETSCHEK SE	1'034	0	0	1'034 EUR	57.88	59'847.92	0.07	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	2'131	560	291	2'400 EUR	158.15	379'560.00	0.44	a)
DE0006602006	GEA GROUP AG	2'574	515	373	2'716 EUR	34.96	94'951.36	0.11	a)
DE0006969603	PUMA SE	1'685	184	0	1'869 EUR	58.80	109'897.20	0.13	a)
DE0007010803	RATIONAL AG	87	4	0	91 EUR	600.00	54'600.00	0.06	a)
DE0007030009	RHEINMETALL AG	682	155	58	779 EUR	243.90	189'998.10	0.22	a)
DE0007037129	RWE AG	10'351	2'441	1'244	11'548 EUR	35.15	405'912.20	0.48	a)
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	12'485	4'057	1'629	14'913 EUR	65.89	982'617.57	1.15	a)
DE0007164600	SAP SE	16'760	4'210	1'592	19'378 EUR	122.82	2'380'005.96	2.79	a)
DE0007165631	SARTORIUS AG-VORZUG	407	203	94	516 EUR	321.80	166'048.80	0.19	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	12'452	3'043	1'399	14'096 EUR	135.66	1'912'263.36	2.24	a)
DE0007664005	VOLKSWAGEN AG	385	246	0	631 EUR	124.70	78'685.70	0.09	a)
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	2'924	1'160	281	3'803 EUR	108.94	414'298.82	0.49	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	7'849	2'756	0	10'605 EUR	7.51	79'601.13	0.09	a)
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	966	265	88	1'143 EUR	207.90	237'629.70	0.28	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	6'635	1'659	831	7'463 EUR	225.70	1'684'399.10	1.97	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2'271	598	337	2'532 EUR	369.10	934'561.20	1.09	a)
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES AG	862	225	127	960 EUR	171.75	164'880.00	0.19	a)
DE000A12DM80	SCOUT24 SE	1'270	152	0	1'422 EUR	65.66	93'368.52	0.11	a)
DE000A161408	HELLOFRESH SE	2'754	174	0	2'928 EUR	28.28	82'803.84	0.10	a)
DE000A1DAH0	BRENTAG SE	2'524	636	402	2'758 EUR	73.48	202'657.84	0.24	a)
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	2'785	728	541	2'972 EUR	166.62	495'194.64	0.58	a)
DE000A1J5RX9	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	18'632	3'755	3'914	18'473 EUR	1.70	31'311.74	0.04	a)
DE000A1ML7J1	VONOVIA SE	11'657	3'746	1'471	13'932 EUR	22.81	317'788.92	0.37	a)
DE000A2E4K43	DELIVERY HERO SE	2'646	816	0	3'462 EUR	27.17	94'062.54	0.11	a)
DE000BASF111	BASF SE	14'954	3'580	1'842	16'692 EUR	42.95	716'921.40	0.84	a)
DE000BAY0017	BAYER AG-REG	15'919	3'766	1'636	18'049 EUR	45.45	820'327.05	0.96	a)
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	17'187	5'020	1'558	20'649 EUR	10.79	222'802.71	0.26	a)
DE000DTROCK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	7'300	2'594	548	9'346 EUR	32.82	306'735.72	0.36	a)
DE000ENAG999	E.ON SE	36'971	9'465	5'342	41'094 EUR	11.20	460'252.80	0.54	a)
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	6'782	2'580	0	9'362 EUR	12.38	115'901.56	0.14	a)
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	3'598	122	0	3'720 EUR	17.33	64'449.00	0.08	a)
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	1'268	17	0	1'285 EUR	60.18	77'331.30	0.09	a)
DE000KGX8881	KION GROUP AG	1'286	0	1'286	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	1'237	76	0	1'313 EUR	65.34	85'791.42	0.10	a)
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	0	2'470	256	2'214 EUR	89.00	197'046.00	0.23	a)
DE000PAH0038	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2'486	545	322	2'709 EUR	46.65	126'374.85	0.15	a)
DE000SHL1006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	4'612	1'022	324	5'310 EUR	48.00	254'880.00	0.30	a)
DE000SYM9999	SYMRISE AG	2'094	600	153	2'541 EUR	90.32	229'503.12	0.27	a)
DE000TLX1005	TALANX AG	0	1'321	0	1'321 EUR	60.00	79'260.00	0.09	a)
DE000UNSE018	UNIPER SE	1'686	0	1'686	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000WCH8881	WACKER CHEMIE AG	0	298	0	298 EUR	135.65	40'423.70	0.05	a)
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	3'841	1'603	1'260	4'184 EUR	21.13	88'407.92	0.10	a)
ES0105046009	AENA SME SA	1'208	345	120	1'433 EUR	142.60	204'345.80	0.24	a)
ES0105066007	CELLNEX TELECOM SA	8'668	2'662	913	10'417 EUR	32.97	343'448.49	0.40	a)
ES0105563003	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	0	1'251	0	1'251 EUR	24.40	30'524.40	0.04	a)
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	7'123	1'927	563	8'487 EUR	57.28	486'135.36	0.57	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	107'344	22'850	20'863	109'331 EUR	7.71	842'942.01	0.99	a)
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	275'431	57'251	34'700	297'982 EUR	3.62	1'078'247.87	1.26	a)
ES0116870314	NATURGY ENERGY GROUP SA	2'587	585	623	2'549 EUR	25.76	65'662.24	0.08	a)
ES0118900010	FERROVIAL SA	7'920	2'604	10'524	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0118900192	FERROVIAL SA	0	127	127	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0125220311	ACCIONA SA	408	30	0	438 EUR	120.70	52'866.60	0.06	a)
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	4'552	2'516	926	6'142 EUR	15.52	95'293.13	0.11	a)
ES0127797027	EDP RENOVAVEIS SA - INTERIM	0	55	55	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0130670112	ENDESA SA	5'575	41	0	5'616 EUR	19.28	108'248.40	0.13	a)
ES0130960018	ENAGAS SA	4'420	0	0	4'420 EUR	15.68	69'305.60	0.08	a)
ES0140609019	CAIXABANK SA	73'011	19'982	14'127	78'866 EUR	3.79	298'586.68	0.35	a)
ES0143416115	SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	4'265	821	5'086	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	96'324	30'690	13'523	113'491 EUR	10.60	1'202'437.15	1.41	a)
ES0144583285	IBERDROLA SA-INTERIM	0	2'842	2'842	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	17'533	4'820	2'154	20'199 EUR	35.29	712'822.71	0.83	a)
ES0167050238	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	0	66	66	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050246	ACS ACTIVIDADES DE CON-SCRIP	0	196	196	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050915	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	3'810	1'095	772	4'133 EUR	34.07	140'811.31	0.16	a)
ES0171996087	GRIFOLS SA	5'364	0	0	5'364 EUR	12.30	65'950.38	0.08	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	4'913	3'258	983	7'188 EUR	14.90	107'065.26	0.13	a)
ES0173516115	REPSOL SA	23'438	4'843	3'688	24'593 EUR	15.57	382'913.01	0.45	a)
ES0178430E18	TELEFONICA SA	86'051	23'794	13'925	95'920 EUR	3.87	371'018.56	0.43	a)
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	4'535	309	0	4'844 EUR	16.97	82'202.68	0.10	a)
FI0009000681	NOKIA OYJ	87'199	26'307	11'857	101'649 EUR	3.57	362'683.63	0.42	a)
FI0009003305	SAMPO OYJ-A SHS	7'696	1'549	699	8'546 EUR	40.98	350'215.08	0.41	a)
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	8'462	2'625	2'693	8'394 EUR	10.76	90'277.47	0.11	a)
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	8'766	3'729	1'444	11'051 EUR	11.89	131'396.39	0.15	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	8'702	2'386	1'038	10'050 EUR	32.47	326'323.50	0.38	a)
FI0009007132	FORTUM OYJ	6'916	958	0	7'874 EUR	11.00	86'574.63	0.10	a)
FI0009007884	ELISA OYJ	2'308	502	288	2'522 EUR	43.89	110'690.58	0.13	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FI0009013296	NESTE OYJ	6'763	2'026	725	8'064 EUR	32.13	259'096.32	0.30	a)
FI0009013403	KONE OYJ-B	5'504	1'161	315	6'350 EUR	39.92	253'492.00	0.30	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	1'853	455	417	1'891 EUR	37.22	70'383.02	0.08	a)
FI0009014575	METSO OUTOTEC OYJ	0	12'851	1'167	11'684 EUR	9.95	116'302.54	0.14	a)
FR0000039299	BOLLORE SE	10'021	5'670	15'691	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	20'103	4'410	1'528	22'985 EUR	11.69	268'740.62	0.31	a)
FR0000051807	TELEPERFORMANCE	963	278	135	1'106 EUR	119.40	132'056.40	0.15	a)
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	515	131	57	589 EUR	1'729.80	1'018'852.20	1.19	a)
FR0000054470	UBISOFT ENTERTAINMENT	1'568	99	1'667	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000064578	COVIVIO	658	250	0	908 EUR	42.10	38'226.80	0.04	a)
FR0000073272	SAFRAN SA	5'560	1'388	551	6'397 EUR	148.64	950'850.08	1.11	a)
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	8'489	2'036	861	9'664 EUR	159.84	1'544'693.76	1.81	a)
FR0000120172	CARREFOUR SA	9'339	3'018	1'681	10'676 EUR	16.29	173'858.66	0.20	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	40'316	9'503	7'981	41'838 EUR	62.31	2'606'925.78	3.05	a)
FR0000120321	L'OREAL	3'913	988	406	4'495 EUR	393.20	1'767'434.00	2.07	a)
FR0000120404	ACCOR SA	2'964	543	0	3'507 EUR	31.94	112'013.58	0.13	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	3'193	878	503	3'568 EUR	33.14	118'243.52	0.14	a)
FR0000120578	SANOFI	18'472	4'748	2'054	21'166 EUR	101.48	2'147'925.68	2.52	a)
FR0000120628	AXA SA	30'309	6'286	3'002	33'593 EUR	28.18	946'650.74	1.11	a)
FR0000120644	DANONE	10'544	2'533	1'088	11'989 EUR	52.26	626'545.14	0.73	a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	3'385	798	332	3'851 EUR	157.85	607'880.35	0.71	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4'500	1'126	498	5'128 EUR	716.40	3'673'699.20	4.30	a)
FR0000121121	EURAZEO SE	695	76	0	771 EUR	56.45	43'522.95	0.05	a)
FR0000121204	WENDEL	229	242	0	471 EUR	75.05	35'348.55	0.04	a)
FR0000121220	SODEXO SA	1'504	448	388	1'564 EUR	97.52	152'521.28	0.18	a)
FR0000121329	THALES SA	1'670	457	138	1'989 EUR	133.10	264'735.90	0.31	a)
FR0000121485	KERING	1'219	293	129	1'383 EUR	431.90	597'317.70	0.70	a)
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	4'686	1'305	553	5'438 EUR	165.16	898'140.08	1.05	a)
FR0000121709	SEB SA	483	158	174	467 EUR	88.65	41'399.55	0.05	a)
FR0000121964	KLEPIERRE	3'592	977	740	3'829 EUR	23.23	88'947.67	0.10	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	8'664	2'304	841	10'127 EUR	156.98	1'589'736.46	1.86	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	10'965	3'086	1'514	12'537 EUR	27.43	343'889.91	0.40	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7'933	1'600	918	8'615 EUR	56.88	490'021.20	0.57	a)
FR0000125338	CAPGEMINI SE	2'525	800	215	3'110 EUR	165.80	515'638.00	0.60	a)
FR0000125486	VINCI SA	8'670	2'186	898	9'958 EUR	105.02	1'045'789.16	1.22	a)
FR0000127771	VIVENDI SE	10'825	5'935	1'676	15'084 EUR	8.30	125'136.86	0.15	a)
FR0000130395	REMY COINTREAU	382	29	0	411 EUR	115.65	47'532.15	0.06	a)
FR0000130452	EIFFAGE	1'423	53	160	1'316 EUR	90.04	118'492.64	0.14	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	3'644	1'074	258	4'460 EUR	71.76	320'049.60	0.37	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	12'982	2'939	2'440	13'481 EUR	23.05	310'669.65	0.36	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	17'990	4'214	2'720	19'484 EUR	60.43	1'177'418.12	1.38	a)
FR0000131906	RENAULT SA	2'854	1'016	0	3'870 EUR	38.88	150'446.25	0.18	a)
FR0000133308	ORANGE	33'038	7'672	5'072	35'638 EUR	10.86	387'028.68	0.45	a)
FR0004125920	AMUNDI SA	710	371	0	1'081 EUR	53.35	57'671.35	0.07	a)
FR0006174348	BUREAU VERITAS SA	5'018	625	430	5'213 EUR	23.51	122'557.63	0.14	a)
FR0010040865	GECINA SA	806	176	165	817 EUR	96.75	79'044.75	0.09	a)
FR0010208488	ENGIE	29'412	7'848	3'862	33'398 EUR	14.53	485'272.94	0.57	a)
FR0010220475	ALSTOM	5'072	1'921	1'417	5'576 EUR	22.60	126'017.60	0.15	a)
FR0010242511	EDF	9'091	1'244	10'335	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010259150	IPSEN	651	17	0	668 EUR	124.20	82'965.60	0.10	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	4'145	950	201	4'894 EUR	87.30	427'246.20	0.50	a)
FR0010313833	ARKEMA	843	210	0	1'053 EUR	93.56	98'518.68	0.12	a)
FR0010340141	ADP	514	12	0	526 EUR	111.90	58'859.40	0.07	a)
FR0010533075	GETLINK SE	7'303	1'570	1'941	6'932 EUR	15.11	104'742.52	0.12	a)
FR0010908533	EDENRED	4'088	883	325	4'646 EUR	59.28	275'414.88	0.32	a)
FR0011981968	WORLDLINE SA	3'819	831	422	4'228 EUR	26.65	112'676.20	0.13	a)
FR0013154002	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	457	99	67	489 EUR	226.00	110'514.00	0.13	a)
FR0013176526	VALEO	3'301	351	0	3'652 EUR	16.33	59'637.16	0.07	a)
FR0013280286	BIOMERIEUX	715	27	0	742 EUR	91.82	68'130.44	0.08	a)
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1'842	249	0	2'091 EUR	46.75	97'754.25	0.11	a)
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1'649	214	0	1'863 EUR	30.80	57'380.40	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC	2'075	833	266	2'642 EUR	53.50	141'347.00	0.17	a)
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	10'020	3'549	887	12'682 EUR	35.30	447'611.19	0.52	a)
FR0014004L86	DASSAULT AVIATION SA	400	44	0	444 EUR	178.40	79'209.60	0.09	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	11'355	2'630	1'363	12'622 EUR	29.07	366'921.54	0.43	a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	3'060	1'146	279	3'927 USD	62.48	231'743.99	0.27	a)
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	2'652	718	380	2'990 EUR	79.18	236'748.20	0.28	a)
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	2'364	872	270	2'966 EUR	70.96	210'467.36	0.25	a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3'931	1'420	411	4'940 EUR	31.56	155'906.40	0.18	a)
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	0	22'478	1'661	20'817 EUR	9.29	193'389.93	0.23	a)
IE00BFOL3536	AIB GROUP PLC	0	23'729	0	23'729 EUR	4.26	101'085.54	0.12	a)
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	2'684	751	221	3'214 EUR	154.90	497'848.60	0.58	a)
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	17'351	3'290	1'998	18'643 EUR	19.37	361'021.70	0.42	a)
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	8'613	3'694	1'655	10'652 EUR	12.53	133'469.56	0.16	a)
IT0000072170	FINCOBANK SPA	9'605	2'398	1'157	10'846 EUR	11.52	124'891.69	0.15	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	264'760	64'129	41'829	287'060 EUR	2.44	700'426.40	0.82	a)
IT0003128367	ENEL SPA	131'359	34'981	16'219	150'121 EUR	5.82	873'704.22	1.02	a)
IT0003132476	ENI SPA	40'786	10'067	7'401	43'452 EUR	15.26	662'903.71	0.78	a)
IT0003153415	SNAM SPA	30'371	12'642	3'234	39'779 EUR	4.45	176'976.77	0.21	a)
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	23'185	8'066	4'050	27'201 EUR	7.13	193'888.73	0.23	a)
IT0003492391	DIASORIN SPA	443	3	0	446 EUR	86.42	38'543.32	0.05	a)
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	192'771	15'760	31'878	176'653 EUR	0.30	52'306.95	0.06	a)
IT0003506190	ATLANTIA SPA	7'909	0	7'909	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	7'346	1'930	0	9'276 EUR	9.97	92'463.17	0.11	a)
IT0003828271	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	1'398	455	0	1'853 EUR	44.71	82'847.63	0.10	a)
IT0004056880	AMPLIFON SPA	1'627	581	0	2'208 EUR	28.12	62'088.96	0.07	a)
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	3'791	1'634	433	4'992 EUR	38.15	190'444.80	0.22	a)
IT0004965148	MONCLER SPA	3'280	861	288	3'853 EUR	55.08	212'223.24	0.25	a)
IT0005090300	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	5'445	2'068	0	7'513 EUR	11.27	84'633.95	0.10	a)
IT0005239360	UNICREDIT SPA	34'144	6'911	6'648	34'407 EUR	22.73	782'071.11	0.92	a)
IT0005366767	NEXI SPA	9'036	2'357	932	10'461 EUR	5.79	60'548.27	0.07	a)
LU0156801721	TENARIS SA	7'321	1'053	0	8'374 EUR	14.99	125'484.39	0.15	a)
LU1598757687	ARCELORMITTAL	8'679	2'840	2'133	9'386 EUR	23.78	223'152.15	0.26	a)
LU1673108939	AROUNDTOWN SA	16'876	818	17'694	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	1'599	823	0	2'422 EUR	71.40	172'930.80	0.20	a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	54'056	9'394	4'972	58'478 EUR	3.12	182'392.88	0.21	a)
NL0000009165	HEINEKEN NV	3'960	1'687	330	5'317 EUR	83.46	443'756.82	0.52	a)
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	13'629	4'785	1'058	17'356 EUR	18.97	329'173.90	0.39	a)
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	2'765	335	3'100	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	10'996	2'723	817	12'902 EUR	40.99	528'788.47	0.62	a)
NL0000235190	AIRBUS SE	9'631	2'301	967	10'965 EUR	126.98	1'392'335.70	1.63	a)
NL0000303709	AEGON NV	29'674	5'426	3'963	31'137 EUR	4.58	142'669.73	0.17	a)
NL0000334118	ASM INTERNATIONAL NV	786	202	129	859 EUR	397.50	341'452.50	0.40	a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	1'908	212	0	2'120 EUR	52.38	111'045.60	0.13	a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	4'241	964	528	4'677 EUR	114.65	536'218.05	0.63	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	2'002	1'617	318	3'301 USD	62.67	195'394.25	0.23	a)
NL0006294274	EURONEXT NV	1'343	410	222	1'531 EUR	66.00	101'046.00	0.12	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	6'603	1'665	792	7'476 EUR	559.10	4'179'831.60	4.90	a)
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	16'838	4'044	2'532	18'350 EUR	11.54	211'759.00	0.25	a)
NL0010558797	OCI NV	1'754	115	0	1'869 EUR	26.39	49'322.91	0.06	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	4'383	964	409	4'938 EUR	30.44	150'312.72	0.18	a)
NL0010801007	IMCD NV	975	183	147	1'011 EUR	120.00	121'320.00	0.14	a)
NL0010832176	ARGENX SE	906	214	98	1'022 EUR	460.60	470'733.20	0.55	a)
NL0011540547	ABN AMRO BANK NV-CVA	7'201	525	565	7'161 EUR	13.44	96'243.84	0.11	a)
NL0011585146	FERRARI NV	2'021	457	143	2'335 EUR	279.70	653'099.50	0.76	a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	16'862	3'926	2'919	17'869 EUR	28.52	509'623.88	0.60	a)
NL0011821202	ING GROEP NV	63'400	14'155	10'605	66'950 EUR	12.55	840'222.50	0.98	a)
NL0011872643	ASR NEDERLAND NV	0	3'088	0	3'088 EUR	35.52	109'685.76	0.13	a)
NL0012015705	JUST EAT TAKEAWAY	3'023	1'442	4'465	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012059018	EXOR NV	1'815	539	216	2'138 EUR	83.94	179'463.72	0.21	a)
NL0012169213	QIAGEN N.V.	3'587	1'242	346	4'483 EUR	38.27	171'564.41	0.20	a)
NL0012866412	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	0	1'406	0	1'406 EUR	93.00	130'758.00	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert EUR	in % 7)	Kat.
NL0012969182	ADYEN NV	351	83	40	394 EUR	705.70	278'045.80	0.33	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	2'982	701	411	3'272 EUR	68.48	224'066.56	0.26	a)
NL0013654783	PROSUS NV	13'457	18'537	3'537	28'457 EUR	27.92	794'519.44	0.93	a)
NL0014332678	JDE PEET'S NV	1'498	830	0	2'328 EUR	26.42	61'505.76	0.07	a)
NL00150001Q9	STELLANTIS NV	35'432	8'595	3'043	40'984 EUR	18.21	746'318.64	0.87	a)
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	11'908	4'681	1'003	15'586 EUR	24.73	385'441.78	0.45	a)
NL0015001FS8	FERROVIAL SE	0	9'795	0	9'795 EUR	28.97	283'761.15	0.33	a)
NL0015435975	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	7'845	2'827	1'355	9'317 EUR	11.17	104'024.31	0.12	a)
PTEDPOAM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	46'492	18'144	7'525	57'111 EUR	3.94	224'788.90	0.26	a)
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	8'852	1'775	1'734	8'893 EUR	14.04	124'857.72	0.15	a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	4'530	496	0	5'026 EUR	21.26	106'852.76	0.13	a)
<b>Diverse</b>							<b>84'607'158.33</b>	<b>99.09</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
BE6343317028	WAREHOUSES DE PAUW CVA-SCRIP	0	2'862	2'862	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A2GSYQ9	VONOVIA SE-SCRIP	0	12'115	12'115	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06189009K1	FERROVIAL SA-RTS	0	7'131	7'131	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0627797907	EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	0	4'177	4'177	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809P3	IBERDROLA SA-RTS	0	107'168	107'168	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809Q1	IBERDROLA SA-RTS	0	105'167	105'167	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509M2	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	0	3'837	3'837	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509N0	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	0	3'937	3'937	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400BQC9	REMY COINTREAU SA-SCRIP	454	0	454	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400GCH7	ESSILORLUXOTTICA SA-SCRIP	0	4'895	4'895	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400HCY0	COVIVIO SA/FRANCE	0	838	838	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400IKH6	ALSTOM SA-SCRIP	0	6'200	6'200	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150013Q4	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	11'908	11'908	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001B69	ABN AMRO BANK NV	0	7'161	7'161	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	4'309	4'309	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001DZ8	UNIVERSAL MUSIC GROUP-SCRIP	0	12'172	12'172	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001E12	NN GROUP NV-SCRIP	0	4'539	4'539	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001FK5	ARCELORMITTAL SA	0	8'778	8'778	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001GE6	AEGON NV-DRIP	0	27'725	27'725	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001I05	FERROVIAL SE-SCRIP	0	9'127	9'127	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LH9	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	4'677	4'677	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LR8	NN GROUP NV	0	4'790	4'790	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LT4	ABN AMRO BANK NV	0	7'161	7'161	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001MH7	AEGON NV-DRIP	0	31'137	31'137	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Futures</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
12/22	EURO STOXX 50	DEC22	4	43	47	0 EUR	0.00	0.00	0.00
03/23	EURO STOXX 50	MAR23	0	40	40	0 EUR	0.00	0.00	0.00
06/23	EURO STOXX 50	JUN23	0	93	93	0 EUR	0.00	0.00	0.00
09/23	EURO STOXX 50	SEP23	0	43	43	0 EUR	0.00	0.00	0.00
12/23	EURO STOXX 50	DEC23	0	17	13	4 EUR	0.00	0.00	0.00 a)
<b>Vermögensaufstellung</b>							<b>Kurswert EUR</b>	<b>in % 7)</b>	
Bankguthaben auf Sicht							740'518.61	0.87	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							84'607'158.33	99.09	
Sonstige Vermögenswerte							34'961.07	0.04	
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>							<b>85'382'638.01</b>	<b>100.00</b>	
Andere Verbindlichkeiten							-2'368.32		
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>							<b>85'380'269.69</b>		



Bewertungskategorien		Kurswert EUR	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);	84'607'158.33	99.09
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## Devisenkurse

CHF	1 = EUR	1.03247704
GBP	1 = EUR	1.15282168
USD	1 = EUR	0.94451000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	166'986.40	0.196
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	EUR	-	-

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

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA EUR	EUR	0.00 - 0.19	-	0.135	0.00 - 0.04	-	0.025
GT EUR	EUR	0.00 - 0.19	-	0.135	0.00 - 0.04	-	0.025
MT EUR	EUR	0.00 - 0.19	-	0.135	0.00 - 0.04	-	0.025
NT EUR	EUR	0.00 - 0.19	-	0.135	0.00 - 0.04	-	0.025

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

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	EUR	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission (PVK) wird verwendet für die Leitung, die Entschädigung der Depotbank (PAF) für die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch für das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermögens.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FA EUR	0.160	0.500	0.060	0.100	4.000
GT EUR	0.100	0.350	0.050	0.050	4.000
MT EUR	-	-	-	-	4.000
NT EUR	-	-	-	-	4.000

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

## 8 Benchmark

MSCI® EMU Index TR Net

## 9 TER

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

## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA EUR	Ja	EUR	3.05000	1.06750	1.98250

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT EUR	Ja	EUR	3.304	1.156	2.148
MT EUR	Ja	EUR	3.050	1.067	1.983
NT EUR	Ja	EUR	3.443	1.205	2.238

## 12 Fussnoten

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

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 21 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugewiesen sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche

Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.