

# SWISSCANTO (CH) EQUITY FUND SYSTEMATIC RESPONSIBLE WORLD ENHANCED

## Jahresbericht per 31.10.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
DA CHF	38329217	CHF
DT CHF	30278409	CHF
FA CHF	32517292	CHF
GT CHF	36348621	CHF
NT CHF	3009874	CHF
NT USD	125531375	USD

Rechnungswährung: CHF

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, 23. Februar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Investment Fund I,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced
- ▶ Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 31. Oktober 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 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. Oktober 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	Collateral ausgeliehene Effekten	22
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	23
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	23
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	23
8	Pauschale Verwaltungskommission	24
9	Benchmark	24
10	TER	24
11	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	25
12	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	25
13	Sonderausschüttung 2022 / 2023	25
14	Fussnoten	26
15	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	27
16	Pflichtpublikationen	29

# 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	01.11.2022	01.11.2021	01.11.2020	01.11.2019
	bis	31.10.2023	31.10.2022	31.10.2021	31.10.2020
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		302'160'037.47	291'533'952.96	309'888'837.88	280'726'068.22
<b>Klasse DA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'115'915.27	2'086'803.95	2'531'082.63	1'911'044.36
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'973.241	18'262.788	19'846.532	20'765.996
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		111.8909	114.2654	127.5327	92.0276
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		111.8238	114.3339	127.6348	91.9816
Ausschüttung je Anteil		1.50	1.50	1.40	1.20
Total Expense Ratio (TER)		-	0.50	0.50	0.50
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	-	-	-
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'980'915.60	1'782'608.41	2'184'616.68	62'271'072.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		12'957.430	11'521.430	12'740.430	506'905.430
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		152.8787	154.7211	171.4712	122.8455
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		152.7870	154.8139	171.6084	122.7841
Thesaurierung je Anteil		2.04	1.88	2.02	1.58
Total Expense Ratio (TER)		-	0.50	0.51	0.50
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.50 %	-	-	-
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'224'289.28	27'716'472.29	32'854'916.74	26'979'281.77
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		185'721.621	199'828.068	212'228.563	241'136.400
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		135.8177	138.7016	154.8091	111.8839
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		135.7362	138.7848	154.9330	111.8280
Ausschüttung je Anteil		1.55	1.55	1.40	1.40
Total Expense Ratio (TER)		-	0.70	0.70	0.70
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.70 %	-	-	-
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'998'993.41	2'928'425.18	3'095'725.34	8'412'972.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'250.000	20'639.956	19'701.268	74'785.334
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		140.2802	141.8814	157.1333	112.4949
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		140.1961	141.9665	157.2590	112.4387
Thesaurierung je Anteil		2.01	1.87	1.99	1.56
Total Expense Ratio (TER)		-	0.40	0.40	0.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	-	-	-
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		258'207'416.47	257'019'643.13	269'222'496.49	181'151'697.51
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		108'145.064	106'684.628	101'169.979	95'269.979
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		2'387.6024	2'409.1535	2'661.0908	1'901.4563
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		2'386.1699	2'410.5990	2'663.2196	1'900.5055
Thesaurierung je Anteil		43.09	40.92	40.79	33.83
Total Expense Ratio (TER)		-	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	-	-	-



Klasse NT USD	USD	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		13'632'507.44
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		144'217.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		103.8709
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		103.8086
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		1.17
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		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 CHF	-0.76 %	-17.01 %	28.00 %	2.13 %
Klasse DT CHF	-0.76 %	-17.00 %	28.00 %	2.12 %
Klasse FA CHF	-1.08 %	-17.12 %	27.74 %	1.92 %
Klasse GT CHF	-0.66 %	-16.92 %	28.13 %	2.22 %
Klasse NT CHF	-0.30 %	-16.62 %	28.52 %	2.61 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	3.81 %	-	-	-
Benchmark	0.55 %	-16.87 %	25.65 %	5.92 %
Tracking Error 33)	1.16 %	1.33 %	1.61 %	1.51 %

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 DA CHF	-1.31 %
Klasse DT CHF	-1.31 %
Klasse FA CHF	-1.63 %
Klasse GT CHF	-1.21 %
Klasse NT CHF	-0.85 %
Klasse NT USD (Lancierung 27.03.2023)	3.26 %

Tracking Differenz und Tracking Error: Das Teilvermögen wird in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv gemanagt, wobei von Anlagen im Referenzindex abgewichen werden kann. Es ist nicht das Ziel, den Index vollständig nachzubilden. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.10.2023	31.10.2022
Bankguthaben auf Sicht	15'189'851.99	5'694'064.55
Bankguthaben auf Zeit	0.00	1'000'750.00
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	271'506'267.36	284'668'353.95
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	15'311'826.96	0.00
Sonstige Vermögenswerte	450'540.68	335'015.27
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>302'458'486.99</b>	<b>291'698'183.77</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-160'460.69	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-137'988.83	-164'230.81
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>302'160'037.47</b>	<b>291'533'952.96</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
<b>Klasse DA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		18'262.788	19'846.532
Ausgegebene Anteile		-	922.000
Zurückgenommene Anteile		-8'289.547	-2'505.744
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>9'973.241</b>	<b>18'262.788</b>
<b>Klasse DT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'521.430	12'740.430
Ausgegebene Anteile		2'945.000	751.000
Zurückgenommene Anteile		-1'509.000	-1'970.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>12'957.430</b>	<b>11'521.430</b>
<b>Klasse FA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		199'828.068	212'228.563
Ausgegebene Anteile		3'938.944	8'148.733
Zurückgenommene Anteile		-18'045.391	-20'549.228
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>185'721.621</b>	<b>199'828.068</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		20'639.956	19'701.268
Ausgegebene Anteile		-	4'488.688
Zurückgenommene Anteile		-6'389.956	-3'550.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>14'250.000</b>	<b>20'639.956</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		106'684.628	101'169.979
Ausgegebene Anteile		33'897.326	37'389.670
Zurückgenommene Anteile		-32'436.890	-31'875.021
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>108'145.064</b>	<b>106'684.628</b>
<b>Klasse NT USD</b>			
		<i>Lancierung</i> 27.03.2023	
	von bis	31.10.2023	
Ausgegebene Anteile		159'292.000	
Zurückgenommene Anteile		-15'075.000	
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>144'217.000</b>	

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		291'533'952.96	309'888'837.88
Ausbezahlte Ausschüttung		-320'492.39	-315'852.24
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'628'283.42	-1'387'702.11
Saldo aus dem Anteilverkehr		10'820'176.39	9'270'118.62
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'754'683.93	-25'921'449.19
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>302'160'037.47</b>	<b>291'533'952.96</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.11.2022 31.10.2023	01.11.2021 31.10.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		153'942.62	1'913.10
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'700.58	-13'454.10
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		4'984'175.35	4'662'357.30
Erträge der Gratisaktien		5'891.19	46'483.30
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		234'838.43	0.00
Erträge aus Wertpapierleihe		25'339.95	7'018.10
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		510'431.53	778'628.89
<b>Total Ertrag</b>		<b>5'912'918.49</b>	<b>5'482'946.59</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-30.53	13.76
Reglementarische Vergütungen		-209'170.98	-243'584.54
Sonstige Aufwendungen		-84.00	-3'144.76
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-517'324.59	-505'840.61
<b>Total Aufwand</b>		<b>-726'610.10</b>	<b>-752'556.15</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>5'186'308.39</b>	<b>4'730'390.44</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-3'720'830.28	5'736'781.94
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		19'241.26	164'193.71
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		100'296.93	110'554.33
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>1'585'016.30</b>	<b>10'741'920.42</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		169'667.63	-36'663'369.61
<b>Gesamterfolg</b>		<b>1'754'683.93</b>	<b>-25'921'449.19</b>

## Verwendung des Erfolges

Klasse DA CHF	31.10.2023	31.10.2022
Nettoertrag	14'826.80	25'295.43
Vortrag des Vorjahres	227.57	2'326.32
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>15'054.37</b>	<b>27'621.75</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	14'959.86	27'394.18
Vortrag auf neue Rechnung	94.51	227.57
<b>Total</b>	<b>15'054.37</b>	<b>27'621.75</b>
<b>Klasse DT CHF</b>	<b>31.10.2023</b>	<b>31.10.2022</b>
Nettoertrag	26'460.78	21'744.03
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>26'460.78</b>	<b>21'744.03</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	9'261.27	7'610.41
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	17'199.51	14'133.62
<b>Total</b>	<b>26'460.78</b>	<b>21'744.03</b>
<b>Klasse FA CHF</b>	<b>31.10.2023</b>	<b>31.10.2022</b>
Nettoertrag	286'453.97	278'179.55
Vortrag des Vorjahres	3'504.52	35'058.47
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>289'958.49</b>	<b>313'238.02</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	287'868.51	309'733.50
Vortrag auf neue Rechnung	2'089.98	3'504.52
<b>Total</b>	<b>289'958.49</b>	<b>313'238.02</b>
<b>Klasse GT CHF</b>	<b>31.10.2023</b>	<b>31.10.2022</b>
Nettoertrag	28'704.39	38'786.03
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>28'704.39</b>	<b>38'786.03</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	10'046.54	13'575.11
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	18'657.85	25'210.92
<b>Total</b>	<b>28'704.39</b>	<b>38'786.03</b>
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>31.10.2023</b>	<b>31.10.2022</b>
Nettoertrag	4'660'168.54	4'366'385.40
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>4'660'168.54</b>	<b>4'366'385.40</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'631'058.99	1'528'234.89
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	3'029'109.55	2'838'150.51
<b>Total</b>	<b>4'660'168.54</b>	<b>4'366'385.40</b>
<b>Klasse NT USD</b>	<b>31.10.2023</b>	
Nettoertrag	169'693.91	
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>169'693.91</b>	
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	59'392.87	
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	110'301.04	
<b>Total</b>	<b>169'693.91</b>	

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>275'405'843.11</b>	<b>91.06</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>271'506'267.36</b>	<b>89.77</b>	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	599	228	827	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>AR</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	3'941	5'059	3'941	5'059 EUR	33.75	164'240.57	0.05	a)
AT0000743059	OMV AG	0	3'856	3'856	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT0000746409	VERBUND AG	0	1'242	1'242	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>AT</b>							<b>164'240.57</b>	<b>0.05</b>	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	31'845	23'224	16'645	38'424 AUD	38.53	853'047.96	0.28	a)
AU000000APA1	APA GROUP	0	141'231	85'309	55'922 AUD	8.24	265'510.54	0.09	a)
AU000000BHP4	BHP GROUP LTD	0	67'526	67'526	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000BXB1	BRAMBLES LTD	0	89'417	89'417	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000DXS1	DEXUS/AU	47'843	71'630	119'473	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000FMG4	FORTESCUE METALS GROUP LTD	0	64'315	25'696	38'619 AUD	22.30	496'223.99	0.16	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	0	272'740	0	272'740 AUD	3.62	568'891.28	0.19	a)
AU000000IAG3	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	0	90'312	0	90'312 AUD	5.67	295'053.24	0.10	a)
AU000000MIN4	MINERAL RESOURCES LTD	10'111	4'107	14'218	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000PLS0	PILBARA MINERALS LTD	0	119'614	119'614	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	112'887	25'223	37'903	100'207 AUD	15.60	900'729.79	0.30	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	260'935	0	260'935	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	0	13'085	0	13'085 AUD	28.75	216'762.15	0.07	a)
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	0	70'965	70'965	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000TSL2	TELSTRA GROUP LTD	0	372'156	372'156	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000WBC1	WESTPAC BANKING CORP	48'862	0	48'862	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000030678	COLES GROUP LTD	33'434	63'311	96'745	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	11'039	303'438	29'008	285'469 AUD	4.94	812'564.36	0.27	a)
AU0000219529	LOTTERY CORP LTD/THE	0	64'888	64'888	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	35'142	53'580	73'382	15'340 AUD	34.26	302'820.02	0.10	a)
<b>AU</b>							<b>4'711'603.33</b>	<b>1.56</b>	
BE0003565737	KBC GROUP NV	11'181	20'107	19'198	12'090 EUR	51.90	603'581.11	0.20	a)
BE0003739530	UCB SA	2'295	1'545	3'840	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	0	611	611	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	0	21'714	18'104	3'610 EUR	53.63	186'233.15	0.06	a)
<b>BE</b>							<b>789'814.26</b>	<b>0.26</b>	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	109'401	12'324	97'077 USD	4.85	428'058.28	0.14	a)
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	0	572	572	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>BM</b>							<b>428'058.28</b>	<b>0.14</b>	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	64'723	45'977	94'103	16'597 CAD	22.31	242'731.83	0.08	a)
CA0084741085	AGNICO EAGLE MINES LTD	0	7'069	7'069	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	0	59'006	47'626	11'380 CAD	6.98	52'070.92	0.02	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	3'590	3'590	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	24'820	8'964	33'784	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	22'077	42'414	42'107	22'384 CAD	48.91	717'683.45	0.24	a)
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	0	16'006	16'006	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1366812024	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1'374	5'721	7'095	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	19'314	38'187	41'507	15'994 CAD	29.34	307'620.15	0.10	a)
CA2861812014	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	0	12'450	12'450	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	0	14'046	14'046	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	0	11'268	7'399	3'869 CAD	168.70	427'869.56	0.14	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	4'545	20'532	25'077	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	33'295	10'194	43'489	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	0	16'492	2'427	14'065 CAD	80.69	743'972.74	0.25	a)
CA4530384086	IMPERIAL OIL LTD	11'632	8'916	20'548	0 CAD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	9'981	2'234	12'215	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	94'172	32'474	61'698 CAD	24.14	976'350.89	0.32	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	14'583	8'204	8'178	14'609 CAD	86.22	825'707.22	0.27	a)
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	0	67'608	12'531	55'077 CAD	19.49	703'687.26	0.23	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	7'266	7'648	7'266	7'648 CAD	74.48	373'409.29	0.12	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	0	8'358	8'358	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	29'555	31'949	39'198	22'306 CAD	46.30	677'018.07	0.22	a)
CA70137W1086	PARKLAND CORP	0	15'790	6'581	9'209 CAD	41.97	253'366.40	0.08	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	33'401	15'441	33'401	15'441 CAD	33.41	338'181.21	0.11	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	5'276	0	5'276 USD	65.37	313'869.41	0.10	a)
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	0	15'717	15'717	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	0	22'776	22'776	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	0	44'153	30'597	13'556 CAD	44.91	399'091.23	0.13	a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	0	2'614	2'614	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	0	27'229	1'613	25'616 CAD	77.46	1'300'727.68	0.43	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	7'645	800	8'445	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA9628791027	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	0	22'279	22'279	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
US5500211090	LULULEMON ATHLETICA INC	0	257	257	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>CA</b>							<b>8'653'357.31</b>	<b>2.86</b>	
CH0114405324	GARMIN LTD	7'499	659	7'499	659 USD	102.53	61'489.59	0.02	a)
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	0	22'334	22'334	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>CH</b>							<b>61'489.59</b>	<b>0.02</b>	
US36118L1061	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	0	1'561	1'561	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>CN</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	0	4'050	4'050	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	51'792	44'781	67'415	29'158 EUR	10.36	290'463.63	0.10	a)
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	0	7'493	7'493	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005200000	BEIERSDORF AG	0	5'060	5'060	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005439004	CONTINENTAL AG	0	798	0	798 EUR	61.44	47'162.42	0.02	a)
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	6'504	6'504	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	0	20'709	6'251	14'458 EUR	68.08	946'825.08	0.31	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	0	4'779	4'779	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006599905	MERCK KGAA	5'838	2'045	4'764	3'119 EUR	142.35	427'085.50	0.14	a)
DE0006602006	GEA GROUP AG	0	39'653	22'430	17'223 EUR	32.23	533'962.91	0.18	a)
DE0006969603	PUMA SE	8'359	0	8'359	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	0	5'883	5'883	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	0	9'988	1'423	8'565 EUR	126.74	1'044'198.47	0.35	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	12'226	3'910	5'572	10'564 EUR	124.96	1'269'817.75	0.42	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	7'241	727	7'968	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	0	6'866	1'097	5'769 EUR	167.20	927'852.19	0.31	a)
DE000ENAG999	E.ON SE	56'209	99'619	90'625	65'203 EUR	11.22	703'724.09	0.23	a)
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	19'339	0	19'339	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	0	2'510	2'510	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000SYM9999	SYMRISE AG	2'646	391	3'037	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>DE</b>							<b>6'191'092.04</b>	<b>2.05</b>	
DK0010244425	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0	113	113	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060079531	DSV A/S	0	576	576	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	14'723	5'030	11'504	8'249 DKK	798.20	848'575.59	0.28	a)
DK0060336014	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2'898	20'759	9'079	14'578 DKK	316.60	594'821.10	0.20	a)
DK0060448595	COLOPLAST-B	0	406	406	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	4'589	10'076	14'665	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060738599	WILLIAM DEMANT HOLDING	24'068	0	24'068	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	23'052	9'418	13'634 DKK	677.00	1'189'568.53	0.39	a)
<b>DK</b>							<b>2'632'965.22</b>	<b>0.87</b>	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	0	13'439	4'012	9'427 EUR	53.82	488'044.23	0.16	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	58'275	20'039	35'675	42'639 EUR	7.42	304'417.73	0.10	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	4'479	4'792	4'849	4'422 EUR	119.00	506'183.15	0.17	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	1'394	38'987	19'190	21'191 EUR	32.55	663'505.35	0.22	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	49'134	49'888	99'022	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>ES</b>							<b>1'962'150.46</b>	<b>0.65</b>	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	43'042	21'770	64'812	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009000681	NOKIA OYJ	0	183'091	183'091	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	0	4'912	4'912	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009007884	ELISA OYJ	0	18'147	530	17'617 EUR	40.08	679'206.22	0.22	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	0	7'358	7'358	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	44'925	89'563	94'841	39'647 SEK	117.30	378'806.48	0.13	a)
<b>FI</b>							<b>1'058'012.70</b>	<b>0.35</b>	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	45'750	19'949	65'699	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	0	189	189	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	0	56'978	30'518	26'460 EUR	63.20	1'608'603.10	0.53	a)
FR0000120321	L'OREAL	0	182	182	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120578	SANOFI	0	9'066	491	8'575 EUR	85.70	706'898.30	0.23	a)
FR0000120628	AXA SA	44'526	13'199	29'070	28'655 EUR	27.96	770'551.90	0.25	a)
FR0000120644	DANONE	21'379	22'742	25'131	18'990 EUR	56.15	1'025'691.39	0.34	a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	6'042	5'695	11'737	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	351	1'717	1'652	416 EUR	674.50	269'908.94	0.09	a)
FR0000121220	SODEXO SA	0	2'266	2'266	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	2'250	874	3'124	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	17'699	19'966	25'739	11'926 EUR	22.90	262'707.38	0.09	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	0	11'214	11'214	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	0	32'518	12'788	19'730 EUR	25.83	490'222.77	0.16	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	0	13'578	11'001	2'577 EUR	71.72	177'785.64	0.06	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	40'802	48'523	52'675	36'650 EUR	21.15	745'458.81	0.25	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	24'736	7'356	12'795	19'297 EUR	54.29	1'007'747.25	0.33	a)
FR0004125920	AMUNDI SA	16'969	0	16'969	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010208488	ENGIE	0	89'809	61'014	28'795 EUR	15.00	415'590.99	0.14	a)
FR0010242511	EDF	0	39'414	39'414	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010259150	IPSEN	1'347	0	1'347	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010307819	LEGRAND SA	9'560	13'977	11'836	11'701 EUR	81.48	917'098.50	0.30	a)
FR0013176526	VALEO	0	63'893	12'541	51'352 EUR	12.44	614'496.94	0.20	a)
<b>FR</b>							<b>9'012'761.91</b>	<b>2.98</b>	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	10'486	11'011	10'303	11'194 AUD	117.58	758'386.56	0.25	a)
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	0	35'931	35'931	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0001367019	BRITISH LAND CO PLC	0	84'122	84'122	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	30'481	34'252	30'481	34'252 GBP	630.00	238'294.28	0.08	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	266'775	75'382	111'919	230'238 GBP	592.30	1'505'933.78	0.50	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	67'692	2'873	70'565	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007908733	SSE PLC	0	71'752	71'752	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007980591	BP PLC	41'090	46'201	87'291	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	1'640	1'996	1'431	2'205 GBP	10'250.00	249'585.64	0.08	a)
GB0030913577	BT GROUP PLC	0	26'226	26'226	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031348658	BARCLAYS PLC	417'569	221'134	386'416	252'287 GBP	131.60	366'638.36	0.12	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	0	59'777	13'220	46'557 GBP	1'692.00	869'906.32	0.29	a)
GB000333F229	CENTRICA PLC	0	694'642	191'609	503'033 GBP	157.30	873'800.60	0.29	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	0	41'816	25'660	16'156 GBP	3'889.00	693'839.35	0.23	a)
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	24'584	44'528	34'217	34'895 GBP	1'613.50	621'755.04	0.21	a)
GB00B1XZ5820	ANGLO AMERICAN PLC	10'047	0	10'047	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	0	11'784	11'784	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	42'045	67'253	73'317	35'981 GBP	2'868.00	1'139'566.08	0.38	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	66'743	3'208	51'923	18'028 GBP	970.60	193'230.19	0.06	a)
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	0	9'676	0	9'676 GBP	2'073.00	221'504.37	0.07	a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	922	4'896	922	4'896 USD	58.51	260'697.44	0.09	a)
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	0	74'044	74'044	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	0	1'327'444	300'150	1'027'294 GBP	75.70	858'771.79	0.28	a)
GB00BJFFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	6'664	5'796	12'460	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	0	366'364	59'408	306'956 GBP	269.70	914'206.30	0.30	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	239'643	137'921	377'564	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BM8Q5M07	JD SPORTS FASHION PLC	0	55'406	55'406	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BN7SWP63	GSK PLC	0	56'215	40'458	15'757 GBP	1'457.40	253'594.27	0.08	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	75'933	28'646	38'992	65'587 GBP	2'646.50	1'916'800.02	0.63	a)
GB00BZ4BQC70	JOHNSON MATTHEY PLC	0	17'933	17'933	0 GBP	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IE00BDB6Q211	WILLIS TOWERS WATSON PLC	1'217	2'967	4'184	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	20'818	18'961	23'326	16'453 USD	58.12	870'233.82	0.29	a)
IE00BZ12WP82	LINDE PLC	0	418	418	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00B4T3BW64	GLENCORE PLC	206'359	0	206'359	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
JE00B783TY65	APTIV PLC	273	0	273	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJN4441	CLARIVATE PLC	0	21'375	21'375	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	8'745	8'434	10'145	7'034 GBP	12'377.93	961'474.01	0.32	a)
LIN GRXXX	LINDE PLC	0	2'946	2'946	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	0	4'242	4'242	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>GB</b>							<b>13'768'218.22</b>	<b>4.55</b>	
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	38'400	542'811	543'811	37'400 HKD	15.14	65'856.79	0.02	a)
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	747'390	149'000	747'390	149'000 HKD	8.10	140'370.03	0.05	a)
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	581'000	1'462'000	2'043'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0016000132	SUN HUNG KAI PROPERTIES	0	108'000	108'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	16'000	57'500	73'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0823032773	LINK REIT	0	118'000	118'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	0	573'000	188'500	384'500 HKD	20.70	925'698.97	0.31	a)
KYG2177B1014	CK ASSET HOLDINGS LTD	76'000	0	76'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	175'800	175'800	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	0	123'000	123'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
<b>HK</b>							<b>1'131'925.79</b>	<b>0.37</b>	
AU000000JHX1	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	34'512	0	34'512	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
CRH ID	CRH PLC	12'367	6'071	18'438	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
GB00B19NLV48	EXPERIAN PLC	11'070	0	11'070	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE0001827041	CRH PLC	0	12'239	917	11'322 GBP	4'421.00	552'752.61	0.18	a)
IE0002424939	DCC PLC	0	1'281	1'281	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE00B48NMY34	ACCENTURE PLC-CL A	4'076	3'404	4'877	2'603 USD	297.09	703'764.66	0.23	a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	0	1'929	1'929	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BFL3536	AIB GROUP PLC	0	107'885	9'413	98'472 EUR	4.09	387'795.34	0.13	a)
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	0	11'535	8'138	3'397 USD	190.31	588'331.92	0.19	a)
IE00BQPQZ61	HORIZON THERAPEUTICS PLC	0	5'588	5'588	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	0	20'584	2'896	17'688 USD	70.56	1'135'801.81	0.38	a)
<b>IE</b>							<b>3'368'446.34</b>	<b>1.11</b>	
IL0002300114	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	0	219'680	219'680	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0002810146	ICL GROUP LTD	0	9'177	9'177	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006046119	BANK LEUMI LE-ISRAEL	0	56'984	10'951	46'033 ILS	2'599.00	269'130.70	0.09	a)
IL0006625771	BANK HAPOALIM BM	44'478	4'833	49'311	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006912120	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	0	67'357	67'357	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006954379	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	0	10'420	10'420	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	2'149	1'242	2'149	1'242 USD	134.25	151'740.37	0.05	a)
IL0011301780	WIX.COM LTD	0	2'470	2'470	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>IL</b>							<b>420'871.07</b>	<b>0.14</b>	
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	21'085	16'572	37'657	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>IM</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	0	61'733	14'610	47'123 EUR	18.75	849'689.72	0.28	a)
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	0	3'761	3'761	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	410'336	70'224	138'223	342'337 EUR	2.46	808'933.07	0.27	a)
IT0003128367	ENEL SPA	80'743	53'480	120'413	13'810 EUR	5.99	79'545.84	0.03	a)
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	0	12'750	12'750	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	86'583	12'389	63'160	35'812 EUR	9.34	321'749.17	0.11	a)
<b>IT</b>							<b>2'059'917.80</b>	<b>0.68</b>	
JE00BY5S4X48	NOVOCURE LTD	0	8'913	8'913	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>JE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
JP3116000005	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	0	27'800	1'100	26'700 JPY	5'436.00	872'169.44	0.29	a)
JP3119600009	AJINOMOTO CO INC	0	33'500	33'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3143600009	ITOCHU CORP	0	44'400	28'000	16'400 JPY	5'373.00	529'505.95	0.18	a)
JP3160400002	EISAI CO LTD	0	18'000	18'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164720009	RENESAS ELECTRONICS CORP	29'400	54'400	28'100	55'700 JPY	1'955.50	654'520.37	0.22	a)
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	22'055	27'100	26'100	23'055 JPY	6'507.00	901'479.98	0.30	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JP3180400008	OSAKA GAS CO LTD	33'500	0	33'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3196000008	ODAKYU ELECTRIC RAILWAY CO	0	9'400	9'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	38'100	14'100	52'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	56'288	27'600	30'600	53'288 JPY	2'715.00	869'379.53	0.29	a)
JP3218900003	CAPCOM CO LTD	4'600	3'900	8'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3256000005	KYOWA KIRIN CO LTD	10'800	0	10'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3258000003	KIRIN HOLDINGS CO LTD	62'500	22'800	85'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3294460005	INPEX CORP	88'400	69'300	157'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3304200003	KOMATSU LTD	0	44'000	8'300	35'700 JPY	3'463.00	742'900.86	0.25	a)
JP3336560002	SUNTORY BEVERAGE & FOOD LTD	0	25'300	25'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3347200002	SHIONOGI & CO LTD	0	14'700	14'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3371200001	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	0	42'900	8'400	34'500 JPY	4'468.00	926'280.27	0.31	a)
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	0	300'900	300'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3409000001	SUMITOMO REALTY & DEVELOPMEN	0	9'000	9'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	0	83'500	15'600	67'900 JPY	2'054.00	838'070.14	0.28	a)
JP3420600003	SEKISUI HOUSE LTD	0	24'100	24'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3421800008	SECOM CO LTD	0	11'300	11'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3429800000	ANA HOLDINGS INC	0	4'600	4'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3435000009	SONY GROUP CORP	3'800	0	3'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3476480003	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	32'100	0	32'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3496400007	KDDI CORP	2'666	10'100	3'866	8'900 JPY	4'487.00	239'969.60	0.08	a)
JP3547670004	PERSOL HOLDINGS CO LTD	12'000	26'500	38'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	51'600	21'400	29'200	43'800 JPY	3'379.00	889'349.48	0.29	a)
JP3596200000	TOTO LTD	21'800	0	21'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3621000003	TORAY INDUSTRIES INC	89'300	218'300	307'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3626800001	LIXIL CORP	54'000	3'400	57'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	0	11'900	0	11'900 JPY	2'590.00	185'206.78	0.06	a)
JP3639650005	PAN PACIFIC INTERNATIONAL HO	0	38'500	1'700	36'800 JPY	2'906.50	642'729.60	0.21	a)
JP3659000008	WEST JAPAN RAILWAY CO	0	1'100	1'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	3'100	37'000	24'900	15'200 JPY	9'683.00	884'430.42	0.29	a)
JP3695200000	NGK INSULATORS LTD	62'500	0	62'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3732000009	SOFTBANK CORP	0	100'100	5'800	94'300 JPY	1'705.00	966'153.72	0.32	a)
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	8'400	0	8'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3749400002	NIPPON PAINT HOLDINGS CO LTD	0	16'400	16'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	34'000	16'700	34'000	16'700 JPY	3'505.00	351'734.24	0.12	a)
JP3787000003	HITACHI CONSTRUCTION MACHINE	0	16'900	0	16'900 JPY	3'852.00	391'185.85	0.13	a)
JP3788600009	HITACHI LTD	0	41'900	21'200	20'700 JPY	9'477.00	1'178'830.54	0.39	a)
JP3802300008	FAST RETAILING CO LTD	0	500	500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3820000002	FUJII ELECTRIC CO LTD	0	3'100	3'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	27'000	0	27'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3837800006	HOYA CORP	0	8'800	8'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	0	157'800	49'200	108'600 JPY	1'506.50	983'125.85	0.33	a)
JP3866800000	PANASONIC HOLDINGS CORP	0	122'600	20'000	102'600 JPY	1'309.00	807'043.90	0.27	a)
JP3868400007	MAZDA MOTOR CORP	20'900	0	20'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3877600001	MARUBENI CORP	12'800	0	12'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3888300005	MITSUI CHEMICALS INC	0	2'800	0	2'800 JPY	3'763.00	63'314.39	0.02	a)
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	0	49'600	49'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	0	31'500	31'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3892100003	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN	27'100	30'800	33'200	24'700 JPY	5'610.00	832'664.35	0.28	a)
JP3893200000	MITSUI FUDOSAN CO LTD	0	35'200	2'300	32'900 JPY	3'247.00	641'930.99	0.21	a)
JP3893600001	MITSUI & CO LTD	2'800	25'900	28'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3897700005	MITSUBISHI CHEMICAL GROUP CO	0	27'600	0	27'600 JPY	848.10	140'658.60	0.05	a)
JP3902400005	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	0	19'700	19'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	58'100	5'000	34'800	28'300 JPY	3'343.00	568'503.27	0.19	a)
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	36'491	61'600	25'600	72'491 JPY	1'900.00	827'652.15	0.27	a)
JP3942600002	YAMAHA CORP	23'300	5'400	28'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942800008	YAMAHA MOTOR CO LTD	0	27'300	27'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3944130008	USS CO LTD	35'300	0	35'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3970300004	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	13'600	18'900	32'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
<b>JP</b>							<b>16'928'790.27</b>	<b>5.60</b>	
LU0156801721	TENARIS SA	0	11'057	11'057	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>LU</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
NL000009082	KONINKLIJKE KPN NV	142'815	250'929	89'728	304'016 EUR	3.18	928'500.53	0.31	a)
NL0000303709	AEGON NV	0	22'631	22'631	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	9'408	5'382	6'204	8'586 EUR	121.10	1'000'177.34	0.33	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	0	7'302	775	6'527 USD	172.43	1'024'216.33	0.34	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	1'915	1'846	2'898	863 EUR	565.30	469'279.70	0.16	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	0	5'483	5'483	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	0	14'061	14'061	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	13'878	5'830	14'641	5'067 EUR	63.26	308'334.47	0.10	a)
<b>NL</b>							<b>3'730'508.37</b>	<b>1.23</b>	
NO0010096985	EQUINOR ASA	18'537	30'851	31'268	18'120 NOK	374.45	552'710.91	0.18	a)
NO0010345853	AKER BP ASA	0	32'974	32'974	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
<b>NO</b>							<b>552'710.91</b>	<b>0.18</b>	
NZEBOE000156	EBOS GROUP LTD	0	7'163	0	7'163 NZD	34.99	132'667.91	0.04	a)
NZMELE000257	MERIDIAN ENERGY LTD	0	105'104	105'104	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	53'242	37'261	90'503	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
<b>NZ</b>							<b>132'667.91</b>	<b>0.04</b>	
PTEDP0AM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	31'838	0	31'838	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	0	19'539	2'858	16'681 EUR	14.21	228'012.23	0.08	a)
<b>PT</b>							<b>228'012.23</b>	<b>0.08</b>	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	0	79'559	12'628	66'931 SEK	149.30	813'947.10	0.27	a)
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	34'003	0	34'003	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	0	69'582	17'745	51'837 SEK	220.90	932'705.70	0.31	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	0	18'884	0	18'884 SEK	124.30	191'193.96	0.06	a)
SE0000667925	TELIA CO AB	288'771	597'660	886'431	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000872095	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	4'901	0	4'901	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	86'331	25'880	112'211	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	0	48'201	48'201	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	35'438	0	35'438	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B	0	7'469	7'469	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0012673267	EVOLUTION AB	0	1'747	1'747	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015811955	INVESTOR AB-A SHS	0	25'732	25'732	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015812219	SWEDISH MATCH AB	0	12'876	12'876	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
<b>SE</b>							<b>1'937'846.76</b>	<b>0.64</b>	
KYG4124C1096	GRAB HOLDINGS LTD - CL A	49'756	18'943	52'663	16'036 USD	3.07	44'802.23	0.01	a)
SG1B51001017	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	0	3'100	3'100	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1M31001969	UNITED OVERSEAS BANK LTD	2'152	0	2'152	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1M77906915	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	0	48'600	48'600	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1504926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	119'600	38'000	41'700	115'900 SGD	12.68	976'183.64	0.32	a)
<b>SG</b>							<b>1'020'985.87</b>	<b>0.34</b>	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	11'102	15'885	26'987	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BMG491BT1088	INVESCO LTD	0	66'152	4'247	61'905 USD	12.97	730'686.29	0.24	a)
GB00BFMBMT84	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21'648	0	21'648	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	0	7'015	7'015	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00059YS762	LINDE PLC	0	2'552	1'459	1'093 USD	382.16	380'128.69	0.13	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	0	9'645	3'054	6'591 USD	207.91	1'247'073.19	0.41	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	18'997	10'944	7'564	22'377 USD	49.02	998'252.54	0.33	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	0	4'864	4'864	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00165C2035	AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	49'387	0	49'387	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	0	100'181	29'132	71'049 USD	15.40	995'735.39	0.33	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	3'898	6'435	9'807	526 USD	94.55	45'259.79	0.01	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	15'189	1'624	12'587	4'226 USD	141.18	542'960.11	0.18	a)
US00507V1098	ACTIVISION BLIZZARD INC	0	5'805	5'805	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00724F1012	ADOBE INC	5'439	1'127	2'178	4'388 USD	532.06	2'124'674.88	0.70	a)
US00751Y1064	ADVANCE AUTO PARTS INC	1'083	2'541	3'624	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	23'468	5'056	21'966	6'558 USD	98.50	587'858.63	0.19	a)
US0090661010	AIRBNB INC-CLASS A	0	5'043	5'043	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2'673	6'033	8'706	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	7'974	610	8'584	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	33'037	17'066	44'556	5'547 USD	24.19	122'112.27	0.04	a)
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	26'681	4'309	16'617	14'373 USD	125.30	1'638'942.63	0.54	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	51'050	24'716	18'578	57'188 USD	124.08	6'457'612.00	2.14	a)
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	0	16'637	13'437	3'200 USD	40.17	116'981.47	0.04	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	47'540	26'167	16'194	57'513 USD	133.09	6'965'891.42	2.30	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	6'345	15'145	11'585	9'905 USD	146.03	1'316'321.03	0.44	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	7'059	3'824	3'145	7'738 USD	178.19	1'254'808.08	0.41	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	0	5'965	253	5'712 USD	185.15	962'447.77	0.32	a)
US0311621009	AMGEN INC	6'462	12'025	13'214	5'273 USD	255.70	1'227'025.97	0.41	a)
US0326541051	ANALOG DEVICES INC	0	7'875	7'875	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	0	35'064	0	35'064 USD	15.61	498'114.99	0.16	a)
US03662Q1058	ANSYS INC	3'397	2'079	2'661	2'815 USD	278.26	712'843.89	0.24	a)
US0367521038	ANTHEM INC	3'045	1'485	2'280	2'250 USD	450.09	921'609.91	0.30	a)
US0378331005	APPLE INC	91'988	31'980	30'082	93'886 USD	170.77	14'590'751.77	4.82	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	14'777	6'905	17'779	3'903 USD	132.35	470'097.29	0.16	a)
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	5'106	8'755	13'861	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0404131064	ARISTA NETWORKS INC	0	5'553	5'553	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	4'511	966	4'702	775 USD	197.63	139'386.22	0.05	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	5'007	5'157	6'619	3'545 USD	218.22	704'005.49	0.23	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	331	286	617	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	2'360	6'438	8'798	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	5'463	5'463	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	67'188	16'460	70'886	12'762 USD	26.34	305'914.29	0.10	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	0	30'624	4'066	26'558 USD	42.50	1'027'187.09	0.34	a)
US0708301041	BATH & BODY WORKS INC	3'527	0	3'527	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	12'868	4'744	17'612	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09062X1037	BIOGEN INC	3'915	1'792	1'357	4'350 USD	237.54	940'353.75	0.31	a)
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	404	402	277	529 USD	2'789.56	1'342'940.07	0.44	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	0	25'656	20'725	4'931 USD	36.90	165'587.15	0.05	a)
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	0	3'963	3'963	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24'422	12'107	8'575	27'954 USD	51.53	1'310'899.38	0.43	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	0	6'044	0	6'044 USD	170.64	938'578.39	0.31	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	3'063	2'247	2'546	2'764 USD	841.37	2'116'363.76	0.70	a)
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	0	5'443	4'372	1'071 USD	108.52	105'770.49	0.03	a)
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	13'709	3'569	17'278	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	4'505	198	4'703	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1264081035	CSX CORP	40'813	47'256	88'069	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1266501006	CVS HEALTH CORP	1'364	7'368	8'732	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12685J1051	CABLE ONE INC	635	0	635	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	0	43'539	5'704	37'835 USD	27.50	946'872.90	0.31	a)
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	6'639	1'873	3'067	5'445 USD	239.85	1'188'510.06	0.39	a)
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	17'775	10'337	3'809	24'303 USD	40.41	893'745.75	0.30	a)
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	8'781	3'254	9'689	2'346 USD	101.29	216'251.85	0.07	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	906	11'278	934	11'250 USD	91.00	931'663.69	0.31	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	27'777	6'805	34'582	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1491231015	CATERPILLAR INC	2'268	8'448	6'253	4'463 USD	226.05	918'114.09	0.30	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1'832	3'088	2'692	2'228 USD	402.80	816'713.82	0.27	a)
US16411R2085	CHEMIERE ENERGY INC	6'366	4'180	10'546	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	6'310	17'517	7'717	16'110 USD	145.73	2'136'533.76	0.71	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	534	555	569	520 USD	1'942.20	919'099.54	0.30	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	12'666	16'960	18'641	10'985 USD	90.94	909'118.02	0.30	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	43'625	9'950	13'182	40'393 USD	52.13	1'916'280.54	0.63	a)
US1729081059	CINTAS CORP	0	4'218	4'053	165 USD	507.12	76'148.25	0.03	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	4'220	0	4'220	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1890541097	CLOROX COMPANY	0	2'950	2'950	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	38'843	36'237	67'063	8'017 USD	56.49	412'143.74	0.14	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	9'730	0	9'730	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US19260Q1076	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	0	3'989	3'989	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	16'402	2'902	19'304	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	49'362	13'691	18'499	44'554 USD	41.29	1'674'159.52	0.55	a)
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	0	33'647	33'647	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	14'626	21'216	21'110	14'732 USD	118.80	1'592'734.56	0.53	a)
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	12'022	7'478	7'488	12'012 USD	87.79	959'678.19	0.32	a)
US2172041061	COPART INC	0	3'320	3'320	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22052L1044	CORTEVA INC	17'389	3'582	20'971	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	933	330	279	984 USD	552.44	494'704.05	0.16	a)
US22788C1053	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	891	0	891	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	9'291	10'168	7'907	11'552 USD	92.98	977'489.22	0.32	a)
US2310211063	CUMMINS INC	4'142	1'645	5'787	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2358511028	DANAHER CORP	960	4'833	5'437	356 USD	192.02	62'210.22	0.02	a)
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	0	9'086	9'086	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US23804L1035	DATADOG INC - CLASS A	2'015	1'406	3'421	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US23918K1088	DAVITA INC	4'428	9'436	13'864	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	0	1'970	276	1'694 USD	597.06	920'442.44	0.30	a)
US2441991054	DEERE & CO	1'820	2'506	4'326	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US24703L2025	DELL TECHNOLOGIES -C	0	4'610	4'610	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	0	5'479	0	5'479 USD	30.41	151'629.25	0.05	a)
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	789	13'074	13'863	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2521311074	DEXCOM INC	0	8'894	8'894	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	0	4'083	2'201	1'882 USD	160.32	274'582.32	0.09	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	2'945	5'064	8'009	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10'115	13'932	11'575	12'472 USD	82.08	931'619.79	0.31	a)
US2561631068	DOCUSIGN INC	0	934	934	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	0	626	626	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25809K1051	DOORDASH INC - A	3'838	0	3'838	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2600031080	DOVER CORP	7'525	1'377	8'902	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2605571031	DOW INC	0	47'992	24'878	23'114 USD	48.34	1'016'826.86	0.34	a)
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	34'442	21'107	42'319	13'230 USD	26.30	316'650.99	0.10	a)
US26614N1028	DUPONT DE NEMOURS INC	3'523	7'393	10'916	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2681501092	DYNATRACE INC	0	2'003	2'003	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26875P1012	EOG RESOURCES INC	0	10'927	10'927	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26884L1098	EQT CORP	23'442	22'973	46'415	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	25'186	8'543	17'972	15'757 USD	39.23	562'544.78	0.19	a)
US2788651006	ECOLAB INC	7'105	4'064	4'569	6'600 USD	167.74	1'007'501.79	0.33	a)
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13'440	20'679	17'856	16'263 USD	63.72	943'065.12	0.31	a)
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	6'196	4'517	10'713	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	13'613	29'638	30'604	12'647 USD	88.97	1'023'991.53	0.34	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	150	100	250	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29444U7000	EQUINIX INC	1'924	1'638	3'562	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	31'341	14'209	42'861	2'689 USD	26.57	65'020.10	0.02	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	0	15'884	0	15'884 USD	33.46	483'672.14	0.16	a)
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	0	29'147	13'748	15'399 USD	53.79	753'805.53	0.25	a)
US30161N1019	EXELON CORP	0	2'256	2'256	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30212P3038	EXPEDIA GROUP INC	7'434	0	7'434	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3021301094	EXPEDITORS INTL WASH INC	2'146	0	2'146	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	33'208	9'979	28'086	15'101 USD	105.85	1'454'661.10	0.48	a)
US3024913036	FMC CORP	4'515	12'043	14'526	2'032 USD	53.20	98'378.59	0.03	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	7'488	6'315	3'993	9'810 USD	301.27	2'689'615.19	0.89	a)
US3032501047	FAIR ISAAC CORP	251	81	332	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US31428X1063	FEDEX CORP	0	6'652	2'943	3'709 USD	240.10	810'427.65	0.27	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	14'111	42'573	35'018	21'666 USD	49.11	968'308.91	0.32	a)
US31620R3030	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	0	18'869	18'869	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	0	41'561	24'819	16'742 USD	23.71	361'246.91	0.12	a)
US3377381088	FISERV INC	0	7'596	7'596	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959E1091	FORTINET INC	10'344	21'615	31'959	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	15'334	4'494	5'457	14'371 USD	65.28	853'753.29	0.28	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	4'399	0	4'399	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	25'124	25'124	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	7'019	8'023	10'368	4'674 USD	27.91	118'717.24	0.04	a)
US36266G1076	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	0	463	463	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3666511072	GARTNER INC	1'549	1'280	2'829	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	18'595	18'595	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US3703341046	GENERAL MILLS INC	14'404	9'127	6'321	17'210 USD	65.24	1'021'786.30	0.34	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	3'810	3'415	1'239	5'986 USD	128.86	701'972.49	0.23	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	19'701	8'046	9'110	18'637 USD	78.54	1'332'085.67	0.44	a)
US37940X1028	GLOBAL PAYMENTS INC	0	1'780	1'780	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	1'958	10'521	12'479	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3841091040	GRACO INC	0	13'484	13'484	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	WW GRAINGER INC	81	1'571	502	1'150 USD	729.83	763'809.06	0.25	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	0	5'610	1'927	3'683 USD	226.14	757'956.64	0.25	a)
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	0	13'803	13'803	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4180561072	HASBRO INC	13'411	10'556	23'967	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4228061093	HEICO CORP	5'321	0	5'321	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4278661081	HERSHEY CO/THE	1'499	4'169	5'668	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42809H1077	HESS CORP	7'942	0	7'942	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	0	14'289	14'289	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4364401012	HOLOGIC INC	4'866	13'716	3'284	15'298 USD	66.17	921'215.09	0.30	a)
US4370761029	HOME DEPOT INC	3'187	1'116	1'587	2'716 USD	284.69	703'667.08	0.23	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	0	12'548	0	12'548 USD	15.48	176'770.88	0.06	a)
US4435106079	HUBBELL INC	0	2'880	139	2'741 USD	270.10	673'750.15	0.22	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	1'284	436	1'720	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	1'944	109	2'053	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	0	108'422	7'027	101'395 USD	9.65	890'449.12	0.29	a)
US45167R1041	IDEX CORP	0	5'128	5'128	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45168D1046	IDEXX LABORATORIES INC	0	758	758	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45337C1027	INCYTE CORP	0	20'565	3'048	17'517 USD	53.93	859'716.78	0.28	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	0	18'706	18'706	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	0	11'367	0	11'367 USD	36.50	377'575.65	0.12	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	250	11'804	2'564	9'490 USD	144.64	1'249'165.21	0.41	a)
US4595061015	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10'351	11'711	22'062	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	0	48'215	19'428	28'787 USD	33.73	883'645.36	0.29	a)
US4606901001	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	0	15'553	15'553	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4612021034	INTUIT INC	0	8'552	5'168	3'384 USD	494.95	1'524'252.57	0.50	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	1'728	3'594	5'322	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	0	26'602	9'855	16'747 USD	59.07	900'262.68	0.30	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	15'132	8'414	7'023	16'523 USD	139.06	2'091'011.31	0.69	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	16'256	14'550	10'952	19'854 USD	148.34	2'680'226.80	0.89	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	0	9'350	0	9'350 USD	26.92	229'061.41	0.08	a)
US4824801009	KLA CORP	2'464	0	2'464	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4878361082	KELLANOVA	12'922	19'237	15'646	16'513 USD	50.47	758'445.78	0.25	a)
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	0	56'484	20'897	35'587 USD	30.33	982'265.84	0.32	a)
US4932671088	KEYCORP	0	77'368	77'368	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	5'955	11'599	9'186	8'368 USD	122.05	929'447.17	0.31	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	0	14'228	4'836	9'392 USD	119.64	1'022'585.76	0.34	a)
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	0	13'221	0	13'221 USD	17.94	215'849.97	0.07	a)
US4990491049	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	4'994	0	4'994	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	0	10'442	10'442	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5010441013	KROGER CO	21'760	5'623	27'383	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5018892084	LKQ CORP	14'111	29'742	23'460	20'393 USD	43.92	815'095.89	0.27	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	0	2'554	208	2'346 USD	588.22	1'255'836.35	0.42	a)
US5324571083	ELI LILLY & CO	6'234	2'488	2'885	5'837 USD	553.93	2'942'455.03	0.97	a)
US5341871094	LINCOLN NATIONAL CORP	0	24'845	24'845	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5486611073	LOWE'S COS INC	7'550	4'795	7'978	4'367 USD	190.57	757'361.07	0.25	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	0	37'712	0	37'712 USD	4.12	141'397.60	0.05	a)
US5502411037	LUMEN TECHNOLOGIES INC	0	39'898	39'898	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US55354G1004	MSCI INC	204	2'328	2'532	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	0	61'711	36'367	25'344 USD	27.31	629'886.23	0.21	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	0	9'079	578	8'501 USD	151.25	1'170'120.68	0.39	a)
US5738741041	MARVELL TECHNOLOGY INC	0	2'364	2'364	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	5'455	5'409	3'671	7'193 USD	376.35	2'463'583.20	0.81	a)
US57638P1049	MASTERBRAND INC	0	4'399	4'399	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57667L1070	MATCH GROUP INC	7'199	4'883	12'082	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5801351017	MCDONALD'S CORP	1'101	953	1'202	852 USD	262.17	203'276.81	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US58155Q1031	MCKESSON CORP	0	1'241	1'241	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	22'956	7'834	7'320	23'470 USD	102.70	2'193'556.31	0.73	a)
US59156R1086	METLIFE INC	16'074	0	16'074	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5926881054	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0	539	539	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5949181045	MICROSOFT CORP	45'817	12'321	14'500	43'638 USD	338.11	13'427'281.93	4.44	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	0	9'123	7'617	1'506 USD	71.29	97'705.46	0.03	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	0	8'764	8'764	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60770K1079	MODERNA INC	4'099	562	4'661	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60855R1005	MOLINA HEALTHCARE INC	728	0	728	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	14'066	18'893	16'607	16'352 USD	57.77	859'683.32	0.28	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	18'362	20'857	19'456	19'763 USD	70.82	1'273'720.23	0.42	a)
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	7'394	5'530	12'924	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US62944T1051	NVR INC	0	55	55	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64110D1046	NETAPP INC	0	5'556	3'188	2'368 USD	72.78	156'840.78	0.05	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	0	424	0	424 USD	411.69	158'855.20	0.05	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	0	26'204	0	26'204 USD	20.68	493'154.93	0.16	a)
US65339F1012	NEXTERA ENERGY INC	530	1'168	1'698	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6541061031	NIKE INC -CL B	0	447	447	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US65473P1057	NISOURCE INC	0	17'369	17'369	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFELOCK INC	0	27'705	27'705	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6703461052	NUCOR CORP	0	8'582	3'438	5'144 USD	147.79	691'848.91	0.23	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	14'417	8'546	6'433	16'530 USD	407.80	6'134'586.99	2.03	a)
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	0	490	41	449 USD	930.44	380'189.37	0.13	a)
US6745991058	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	394	16'134	16'528	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	0	1'608	0	1'608 USD	376.66	551'189.33	0.18	a)
US6819191064	OMNICOM GROUP	0	6'176	6'176	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	7'075	0	7'075	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68389X1054	ORACLE CORP	0	9'129	4'557	4'572 USD	103.40	430'221.41	0.14	a)
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	0	26'188	23'952	2'236 USD	77.21	157'112.45	0.05	a)
US69047Q1022	OVINTIV INC	0	11'289	11'289	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	0	8'758	2'062	6'696 USD	113.37	690'842.18	0.23	a)
US69331C1080	P G & E CORP	0	13'098	13'098	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	0	11'975	8'248	3'727 USD	114.47	388'254.35	0.13	a)
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	0	17'767	9'076	8'691 USD	122.77	971'017.95	0.32	a)
US69370C1009	PTC INC	0	2'237	2'237	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	0	992	0	992 USD	153.05	138'168.89	0.05	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	0	7'328	4'088	3'240 USD	243.02	716'559.54	0.24	a)
US7043261079	PAYCHEX INC	480	0	480	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	0	32'476	27'105	5'371 USD	51.80	253'192.11	0.08	a)
US7134481081	PEPSICO INC	3'517	19'224	19'939	2'802 USD	163.28	416'357.49	0.14	a)
US7170811035	PFIZER INC	42'856	81'809	78'016	46'649 USD	30.56	1'297'361.31	0.43	a)
US7185461040	PHILLIPS 66	0	2'699	0	2'699 USD	114.07	280'181.58	0.09	a)
US71880K1016	PHINIA INC	0	4'691	4'691	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72352L1061	PINTEREST INC- CLASS A	0	15'489	15'489	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	0	955	955	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72919P2020	PLUG POWER INC	3'829	5'383	9'212	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	20'836	11'905	13'128	19'613 USD	150.03	2'677'857.06	0.89	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10'566	17'847	16'202	12'211 USD	91.44	1'016'138.02	0.34	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	0	15'448	973	14'475 USD	73.59	969'399.14	0.32	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	12'414	9'093	11'953	9'554 USD	108.99	947'626.38	0.31	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	0	9'161	1'135	8'026 USD	130.10	950'258.38	0.31	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	0	2'344	596	1'748 USD	779.89	1'240'623.59	0.41	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	25'699	38'436	56'905	7'230 USD	14.53	95'602.48	0.03	a)
US7595091023	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	0	4'241	3'818	423 USD	254.38	97'923.87	0.03	a)
US76954A1034	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	8'190	11'724	19'914	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7703231032	ROBERT HALF INC	674	11'878	5'403	7'149 USD	74.77	486'449.69	0.16	a)
US7739031091	ROCKWELL AUTOMATION INC	0	3'491	3'491	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7757111049	ROLLINS INC	0	8'906	8'906	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7782961038	ROSS STORES INC	0	3'204	3'204	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	999	0	999	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	0	5'396	5'396	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US79466L3024	SALESFORCE INC	2'828	11'028	3'853	10'003 USD	200.83	1'828'201.71	0.60	a)
US8064071025	HENRY SCHEIN INC	620	3'802	2'560	1'862 USD	64.98	110'109.46	0.04	a)
US8168511090	SEMPRA	6'720	1'896	8'616	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81762P1021	SERVICENOW INC	1'707	3'215	2'059	2'863 USD	581.85	1'515'994.55	0.50	a)
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	0	12'177	6'850	5'327 USD	109.89	532'728.74	0.18	a)
US82968B1035	SIRIUS XM HOLDINGS INC	22'002	80'885	102'887	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8318652091	SMITH (A.O.) CORP	2'951	0	2'951	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	0	8'739	0	8'739 USD	113.84	905'361.20	0.30	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	4'226	738	1'280	3'684 USD	257.94	864'775.89	0.29	a)
US83304A1060	SNAP INC - A	12'357	26'688	39'045	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8552441094	STARBUCKS CORP	8'957	0	8'957	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8574771031	STATE STREET CORP	0	18'023	3'284	14'739 USD	64.63	866'896.86	0.29	a)
US8581191009	STEEL DYNAMICS INC	0	1'845	1'845	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716071076	SYNOPSIS INC	3'790	680	1'563	2'907 USD	469.44	1'241'910.73	0.41	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	0	47'731	17'983	29'748 USD	28.05	759'374.30	0.25	a)
US8718291078	SYSCO CORP	0	20'777	4'272	16'505 USD	66.49	998'704.75	0.33	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	4'290	0	4'290	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US87918A1051	TELADOC HEALTH INC	15'147	0	15'147	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88160R1014	TESLA INC	17'614	7'279	9'772	15'121 USD	200.84	2'763'732.34	0.91	a)
US8825081040	TEXAS INSTRUMENTS INC	6'348	5'423	11'771	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	687	196	715	168 USD	444.77	68'000.17	0.02	a)
US88579Y1010	3M CO	10'431	5'831	2'841	13'421 USD	90.95	1'110'843.39	0.37	a)
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	0	1'124	1'124	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89400J1079	TRANSUNION	0	6'226	6'226	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8962391004	TRIMBLE INC	16'059	0	16'059	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	0	28'315	28'315	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9026811052	UGI CORP	26'130	41'845	67'975	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	0	34'407	4'846	29'561 USD	43.28	1'164'318.04	0.38	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	1'156	983	2'139	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113121068	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7'690	0	7'690	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113631090	UNITED RENTALS INC	3'342	1'228	2'176	2'394 USD	406.27	885'124.08	0.29	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	7'212	1'951	5'466	3'697 USD	535.56	1'801'867.44	0.60	a)
US9182041080	VF CORP	13'615	52'725	49'051	17'289 USD	14.73	231'759.68	0.08	a)
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	3'100	4'706	3'346	4'460 USD	212.25	861'485.18	0.28	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	2'457	13'233	11'719	3'971 USD	127.00	458'953.69	0.15	a)
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2'641	0	2'641	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92276F1003	VENTAS INC	3'850	0	3'850	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92338C1036	VERALTO CORP	0	6'071	0	6'071 USD	69.00	381'219.03	0.13	a)
US92343E1029	VERISIGN INC	0	2'531	2'531	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	48'329	30'565	75'612	3'282 USD	35.13	104'925.73	0.03	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	0	5'493	582	4'911 USD	227.36	1'016'129.94	0.34	a)
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4'274	3'332	3'637	3'969 USD	362.11	1'307'937.14	0.43	a)
US9256521090	VICI PROPERTIES INC	10'532	0	10'532	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	14'238	6'730	7'705	13'263 USD	235.10	2'837'655.39	0.94	a)
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	0	9'157	9'157	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92942W1071	WK KELLOGG CO	0	4'496	4'496	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	0	434	434	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9311421039	WALMART INC	2'947	9'976	8'072	4'851 USD	163.41	721'398.37	0.24	a)
US9344231041	WARNER BROS DISCOVERY INC	46'366	0	46'366	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9418481035	WATERS CORP	1'719	0	1'719	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	3'830	16'775	20'605	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US95040Q1040	WELLTOWER INC	0	4'279	4'279	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US96145D1054	WESTROCK CO	0	36'841	36'841	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	0	6'509	1'086	5'423 USD	211.71	1'044'831.44	0.35	a)
US98419M1009	XYLEM INC	9'711	6'012	4'194	11'529 USD	93.54	981'418.54	0.32	a)
US9884981013	YUM! BRANDS INC	8'920	1'773	10'693	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9892071054	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3'398	635	4'033	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	0	15'750	0	15'750 USD	36.25	519'581.67	0.17	a)
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	0	20'454	10'671	9'783 USD	104.41	929'564.23	0.31	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	8'276	5'712	13'988	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	8'663	19'373	8'920	19'116 USD	12.96	225'458.84	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US98980G1022	ZSCALER INC	2'384	355	2'739	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980L1017	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	0	1'535	1'535	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>US</b>							<b>190'559'820.15</b>	<b>63.00</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
GB00BMX3XR77	SHELL PLC-EEE AUG23	0	77'130	77'130	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	0	75'141	75'141	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XV14	SHELL PLC-EEE MAY23	0	70'476	70'476	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BPV8W887	SHELL PLC-EEE NOV2022	0	75'933	75'933	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	7'928	7'928	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LH9	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	9'809	9'809	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LR8	NN GROUP NV	0	5'319	5'319	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>3'899'575.75</b>	<b>1.29</b>	
IE00BF4G7076	JPM US REI ESG UCITS ETF	0	189'417	85'000	104'417 USD	41.04	3'899'575.75	1.29	a)
<b>GB</b>							<b>3'899'575.75</b>	<b>1.29</b>	

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

							<b>11'412'251.21</b>	<b>3.77</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>11'412'251.21</b>	<b>3.77</b>	
OU1900091650	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE USA NT	0	51'965	51'965	0 USD	0.00	0.00	0.00	
OU1900092039	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE EUROZONE NT	0	17'626	17'626	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
OU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	0	15'080	15'080	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
LU1900091650	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE USA NT	0	51'965	0	51'965 USD	159.01	7'519'683.31	2.49	a)
LU1900092039	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE EUROZONE NT	0	17'626	0	17'626 EUR	137.13	2'325'005.20	0.77	a)
LU1900092971	SWC (LU) EF SYSTEMATIC RESPONSIBLE JAPAN NT CHF	0	15'080	0	15'080 CHF	103.95	1'567'562.70	0.52	a)
<b>LU</b>							<b>11'412'251.21</b>	<b>3.77</b>	

### Derivative Finanzinstrumente

							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Futures</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
12/22	NIKKEI 225 (SGX) DEC22	4	0	4	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
12/22	SPI 200 FUTURES DEC22	1	1	2	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/22	EURO STOXX 50 DEC22	17	0	17	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/22	S&P500 EMINI FUT DEC22	26	3	29	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/22	FTSE 100 IDX FUT DEC22	4	0	4	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/22	S&P/TSX 60 IX FUT DEC22	1	1	2	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/23	NIKKEI 225 (SGX) MAR23	0	7	7	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/23	SPI 200 FUTURES MAR23	0	1	1	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	0	21	21	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P500 EMINI FUT MAR23	0	40	40	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	FTSE 100 IDX FUT MAR23	0	6	6	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P/TSX 60 IX FUT MAR23	0	3	3	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
06/23	NIKKEI 225 (SGX) JUN23	0	24	24	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
06/23	SPI 200 FUTURES JUN23	0	5	5	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	74	74	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P500 EMINI FUT JUN23	0	118	118	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	15	15	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P/TSX 60 IX FUT JUN23	0	8	8	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	NIKKEI 225 (SGX) SEP23	0	14	14	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO STOXX 50 SEP23	0	41	41	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P500 EMINI FUT SEP23	0	84	84	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	FTSE 100 IDX FUT SEP23	0	8	8	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P/TSX 60 IX FUT SEP23	0	3	3	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SPI 200 FUTURES SEP23	0	4	4	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	NIKKEI 225 (SGX) DEC23	0	3	1	2 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	0	9	8	1 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	0	22	19	3 USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	3	3	0 GBP	0.00	0.00	0.00	



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.11.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.10.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	0	1	1	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	0	1	0	1 AUD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Devisentermingeschäfte

USD/AUD	Verfall 02.05.2023	421'000	278'473		AUD/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 02.05.2023	456'000	335'027		CAD/USD		0.00	0.00	
USD/DKK	Verfall 02.05.2023	597'000	88'184		DKK/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 04.05.2023	97'000	71'326		CAD/USD		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.07.2023	134'000	90'754		CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.07.2023	24'952'000	154'833		JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.07.2023	118'000	134'213		GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.07.2023	1'970'000	1'765'563		USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 06.07.2023	234'000	228'731		EUR/CHF		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall 28.07.2023	130'000	98'321		CAD/USD		0.00	0.00	
HKD/USD	Verfall 03.08.2023	473'000	3'689'174		USD/HKD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 08.08.2023	190'000	30'927'046		CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 08.08.2023	342'438	300'000		USD/CHF		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 08.08.2023	55'000	84'269		CHF/SGD		0.00	0.00	
JPY/USD	Verfall 05.09.2023	898'000	130'913'942		USD/JPY		0.00	0.00	
AUD/USD	Verfall 05.09.2023	342'000	526'848		USD/AUD		0.00	0.00	
HKD/USD	Verfall 05.09.2023	95'000	745'332		USD/HKD		0.00	0.00	
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	15'189'851.99	5.02
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	271'506'267.36	89.77
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	15'311'826.96	5.06
Sonstige Vermögenswerte	450'540.68	0.15
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>302'458'486.99</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-160'460.69	
Andere Verbindlichkeiten	-137'988.83	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>302'160'037.47</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	286'818'094.32	94.83
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

#### Ausgeliehene Effekten

<b>Ausgeliehene Effekten</b>	<b>71'833'734.46</b>	<b>23.75</b>
------------------------------	----------------------	--------------

#### Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte

				Kurswert CHF	in % 7)	
FR0000120628	AXA SA	28'655	EUR	27.96	770'551.90	0.25
FR0000120644	DANONE	16'734	EUR	56.15	903'839.90	0.30
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	19'730	EUR	25.83	490'222.77	0.16
FR0000131104	BNP PARIBAS	19'297	EUR	54.29	1'007'747.25	0.33
FR0010307819	LEGRAND SA	11'079	EUR	81.48	868'347.52	0.29
US00724F1012	ADOBE INC	4'388	USD	532.06	2'124'674.88	0.70
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	14'373	USD	125.30	1'638'942.63	0.54
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	57'188	USD	124.08	6'457'612.00	2.14
US0231351067	AMAZON.COM INC	57'513	USD	133.09	6'965'891.42	2.30
US0378331005	APPLE INC	93'886	USD	170.77	14'590'751.77	4.82
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	529	USD	2'789.56	1'342'940.07	0.44
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	5'445	USD	239.85	1'188'510.06	0.39
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2'153	USD	402.80	789'221.21	0.26
US1667641005	CHEVRON CORP	16'110	USD	145.73	2'136'533.76	0.71
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	2'061	USD	88.97	166'873.29	0.06
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	15'101	USD	105.85	1'454'661.10	0.48
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	9'810	USD	301.27	2'689'615.19	0.89

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.10.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)	Kat.
US4364401012	HOLOGIC INC	4'825 USD	66.17	290'551.89	0.10	
US4370761029	HOME DEPOT INC	2'716 USD	284.69	703'667.08	0.23	
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	9'490 USD	144.64	1'249'165.21	0.41	
US5324571083	ELI LILLY & CO	5'837 USD	553.93	2'942'455.03	0.97	
US5494981039	LUCID GROUP INC	37'712 USD	4.12	141'397.60	0.05	
US64110L1061	NETFLIX INC	111 USD	411.69	41'587.09	0.01	
US67066G1040	NVIDIA CORP	16'530 USD	407.80	6'134'586.99	2.03	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	2'418 USD	51.80	113'985.95	0.04	
US7170811035	PFIZER INC	20'000 USD	30.56	556'222.56	0.18	
US7475251036	QUALCOMM INC	9'554 USD	108.99	947'626.38	0.31	
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	1'748 USD	779.89	1'240'623.59	0.41	
US79466L3024	SALESFORCE INC	8'187 USD	200.83	1'496'299.85	0.49	
US81762P1021	SERVICENOW INC	2'863 USD	581.85	1'515'994.55	0.50	
US8716071076	SYNOPSIS INC	2'907 USD	469.44	1'241'910.73	0.41	
US88160R1014	TESLA INC	15'121 USD	200.84	2'763'732.34	0.91	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3'969 USD	362.11	1'307'937.14	0.43	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	13'263 USD	235.10	2'837'655.39	0.94	
US9311421039	WALMART INC	4'851 USD	163.41	721'398.37	0.24	

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57619816
CAD	1 = CHF	0.65553755
DKK	100 = CHF	12.88776200
EUR	1 = CHF	0.96192671
GBP	1 = CHF	1.10430017
HKD	100 = CHF	11.63062600
ILS	1 = CHF	0.22495087
JPY	100 = CHF	0.60091100
NOK	100 = CHF	8.14603000
NZD	1 = CHF	0.52933058
SEK	100 = CHF	8.14533700
SGD	1 = CHF	0.66424583
USD	1 = CHF	0.91005000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	7'400'259.00	9.225
Bank account	CHF	28.22	0.000
Bond	CHF	72'794'388.48	90.746
Equity	CHF	23'277.96	0.029
Total	CHF	80'217'953.66	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	894'659.72	0.296
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

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

Periode: 01.11.2022 - 31.10.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
DA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-
FA CHF	CHF	-	-	-	-
GT CHF	CHF	-	-	-	-
NT CHF	CHF	-	-	-	-
NT USD	CHF	-	-	-	-

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	71'833'734.46
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 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:** 01.11.2022 - 31.10.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DA CHF	0.500	0.700	0.450	0.050	2.000
DT CHF	0.500	0.700	0.450	0.050	2.000
FA CHF	0.700	0.900	0.600	0.100	2.000
GT CHF	0.400	0.600	0.350	0.050	2.000
NT CHF	-	-	-	-	2.000

**Periode:** 27.03.2023 - 31.10.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
NT USD	-	-	-	-	2.000

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

MSCI World ex Switzerland Index TR Net

## 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 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DA CHF	Ja	CHF	1.50000	0.52500	0.97500
FA CHF	Ja	CHF	1.55000	0.54250	1.00750

## 12 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.02.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Ja	CHF	2.042	0.714	1.328
GT CHF	Ja	CHF	2.014	0.704	1.310
NT CHF	Ja	CHF	43.091	15.081	28.010
NT USD	Ja	CHF	1.176	0.411	0.765

## 13 Sonderausschüttung 2022 / 2023

Ex-Datum: 21.02.2024

Sonderausschüttung der ausländischen Quellensteuer

Zahlbar: 24.02.2024

Klasse	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	CHF	0.65000	0.22750	0.42250

## 14 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.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.  
Berechnungsformel:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

## 15 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Bank- oder 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, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens im Sinne von § 6 Ziff. 1 oben 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.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des Teilvermögens bewirken.

Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der modifizierte Nettoinventarwert wird jeweils auf 0.0001 der

Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit Rechnungseinheit JPY wird der modifizierte Nettoinventarwert jeweils auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.

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 § 19 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 Prüfungsgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der 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 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 des Teilvermögens, getätigt wurden.



## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Investment Fund I

vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend "der Umbrella-Fonds")

Zurzeit mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

(nachfolgend "die Teilvermögen")

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

Im Rahmen der vorherigen Fondsvertragsüberarbeitung mit Inkrafttreten 14. September 2022 wurde die Anlagepolitik und die Risikoverteilung soweit möglich dem Musterfondsvertrag der Asset Management Association Switzerland angepasst und Bestimmungen in diesen Bereichen standardisiert, harmonisiert und vereinfacht. Mit dieser Fondsvertragsänderung waren keine Umschichtungen von Anlagen in den Teilvermögen und keine Änderung der effektiven Anlagepolitik der Teilvermögen verbunden.

Die Teilvermögen des Umbrella-Fonds werden in Anlehnung an einen Referenzindex aktiv verwaltet. Diesem Sachverhalt trägt die Bestimmung von § 16 Ziff. 4 Rechnung. Darin ist festgehalten, dass wenn sich ein Teilvermögen an einem Referenzindex (Benchmark) orientiert, der Anteil desselben Emittenten am Vermögen eines Teilvermögens die Limiten von § 16 Ziff. 3 übersteigen darf. Im Rahmen der vorherigen Fondsvertragsüberarbeitung mit Inkrafttreten 14. September 2022 wurde dem Umstand, dass dies für sämtliche Effekten und Geldmarktinstrumente Anwendung finden soll, nicht genügend Rechnung getragen. Entsprechend soll mit dieser Fondsvertragsüberarbeitung diese Bestimmung für sämtliche Effekten oder Geldmarktinstrumente desselben Emittenten gelten und somit auch bei den Obligationen-Teilvermögen zur Anwendung kommen.

Pfandbriefe der Pfandbriefbank und der Pfandbriefzentrale weisen gemäss Referenzindex der Teilvermögen Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF und Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF einen Anteil von über 10% am Referenzindex auf. Bei beiden Teilvermögen beträgt der Anteil in Pfandbriefen der Pfandbriefbank und der Pfandbriefzentrale ebenfalls über 10% des Vermögens der Teilvermögen. Mit der Erweiterung in § 16 Ziff. 4 von ehemals Beteiligungswertpapieren und -wertrechten auf neu Effekten oder Geldmarktinstrumente wird fortan diese Bestimmung die Emittentenbegrenzung definieren. Aktuell kommt die Gesamtbeschränkung von § 16 Ziff. 7 zur Anwendung. Diese beinhaltet, dass Anlagen, Guthaben und Forderungen desselben Emittenten bzw. Schuldner insgesamt 20% des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen darf.

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> 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 umschriebene Änderung des Fondsvertrags 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 Fondsvertrags Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, der Jahres- und Halbjahresbericht, die wesentlichen Informationen für die Anlegerinnen und Anleger sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 10. November 2022

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Investment Fund I

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übriger Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable International

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality

Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II)

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates

Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced

Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland

Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF)

(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 nachstehend aufgeführten Teilvermögen soll in § 8 Ziff. 5 B Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 C Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 D Bst. d, § 8 Ziff. 5 E Bst. d, § 8 Ziff. 5 F Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 G Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 H Bst. a und c, § 8 Ziff. 5 I Bst. d, § 8 Ziff. 5 J Bst. d und § 8 Ziff. 5 K Bst. a und c des Fondsvertrages präzisiert werden.

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

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 B Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Sustainable Global Aggregate ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf eine andere Währung als den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 C Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind,

wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (§ 8 Ziff. 5 C Bst. c).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible Switzerland High Quality ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 D Bst. d).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Responsible World ex CH (II) ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 E Bst. d).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 F Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Short Duration CHF ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die auf den Schweizer Franken lauten und mit Bonität Investment Grade (Mindestrating BBB- oder gleichwertig), zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 G Bst. c).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Rates ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die nicht auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 H Bst. c).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 I Bst. d).

In der angepassten Bestimmung des Swisscanto (CH) Equity Fund Sustainable Switzerland ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Optionsanleihen, Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, zu den zulässigen Nebenanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 J Bst. d).

In den angepassten Bestimmungen des Swisscanto (CH) Bond Fund Responsible Global Aggregate (ex CHF) ist damit neu festgehalten, dass Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.) von privaten und öffentlich-rechtlichen Schuldnern weltweit, die nicht auf den Schweizer Franken lauten, zu den zulässigen Hauptanlagen gehören (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. a). Zudem gehören Forderungswertpapiere und -wertrechte (Obligationen, Notes, Options- und Wandelanleihen, Bail-in Bonds, Contingent Convertible Bonds sowie Schuldverschreibungen, die durch Anlagen besichert sind, wie schweizerische Pfandbriefe, ABS, MBS u.Ä.), welche die Anforderungen von Bst. a nicht erfüllen, zu den zulässigen Nebenanlagen (vgl. § 8 Ziff. 5 K Bst. c).

\* \* \*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> 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, 22. Mai 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich