

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND WORLD EX US EX CH

Jahresbericht per 31.01.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DTH1 CHF	117543167	CHF
NT CHF	24542674	CHF
NTH1 CHF	30024952	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 30. Mai 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund II,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.
- ▶ Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

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

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



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet.

Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	23
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	24
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	24
7	Pauschale Verwaltungskommission	24
8	Benchmark	25
9	TER	25
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	25
11	Fussnoten	25
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	26
13	Pflichtpublikationen	28

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'247'661.47	24'441'135.98	27'153'355.89	42'856'436.78
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		18'619'218.42	18'736'226.43	20'785'236.56	36'523'734.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		144'975.118	148'117.551	156'439.690	310'688.272
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		128.4304	126.4957	132.8642	117.5575
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		149.7120	137.6823	142.7036	132.1465
Thesaurierung je Anteil		3.67	3.36	3.29	2.70
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.03 %	0.04 %
Klasse NTH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'628'443.05	5'704'909.55	6'368'119.33	6'332'702.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		17'463.138	41'449.207	47'089.045	53'574.333
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		150.5138	137.6362	135.2357	118.2040
Thesaurierung je Anteil		4.14	3.52	3.27	2.72
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.03 %	0.04 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DTH1 CHF (Lancierung 31.03.2022, Schliessung 12.05.2022)	-	-	-6.65 %	-
Klasse NT CHF	2.49 %	7.67 %	-12.55 %	15.83 %
Klasse NTH1 CHF	10.32 %	14.78 %	-6.58 %	18.58 %
Benchmark Hedge	10.13 %	14.58 %	-6.55 %	-
Benchmark	2.29 %	7.49 %	-12.55 %	15.42 %
Tracking Error ³³⁾	0.11 %	0.09 %	0.08 %	0.29 %

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 NT CHF	0.20 %
Klasse NTH1 CHF	0.19 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.01.2024	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	215'753.54	190'110.58
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	13'942'701.21	16'055'454.36
Bezugsrechte	101.93	189.06
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	7'072'378.65	8'181'960.43
Sonstige Vermögenswerte	94'926.18	86'215.91
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	21'325'861.51	24'513'930.34
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-68'820.71	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-9'379.33	-72'794.36
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	21'247'661.47	24'441'135.98

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	Lancierung 31.03.2022 12.05.2022
Klasse DTH1 CHF			
Ausgegebene Anteile		-	24'218.943
Zurückgenommene Anteile		-	-24'218.943
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		-	-

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		148'117.551	156'439.690
Ausgegebene Anteile		2'779.952	-
Zurückgenommene Anteile		-5'922.385	-8'322.139
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		144'975.118	148'117.551

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		41'449.207	47'089.045
Ausgegebene Anteile		2'197.003	1'289.761
Zurückgenommene Anteile		-26'183.072	-6'929.599
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		17'463.138	41'449.207

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		24'441'135.98	27'153'355.89
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-223'515.79	-223'985.48
Saldo aus dem Anteilverkehr		-3'770'489.09	-1'683'656.13
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		800'530.37	-804'578.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		21'247'661.47	24'441'135.98

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.01.2024	01.02.2022 31.01.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'947.28	27.48
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-159.33	-629.66
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		446'498.86	446'108.00
Erträge der Gratisaktien		18'267.12	5'336.42
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		237'596.24	214'291.84
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		15'427.82	5'118.39
Total Ertrag		719'577.99	670'252.47
Aufwand			
Passivzinsen		-45.72	-149.55
Sonstige Aufwendungen		-4.40	-7.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-114'015.51	-25'528.29
Total Aufwand		-114'065.63	-25'685.74
Nettoertrag / Verlust		605'512.36	644'566.73
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		552'709.17	423'670.24
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		13'887.83	18'500.67
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		2'688.65	6'743.91
Realisierter Erfolg		1'174'798.01	1'093'481.55
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-374'267.64	-1'898'059.85
Gesamterfolg		800'530.37	-804'578.30

Verwendung des Erfolges

Klasse NT CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	533'212.92	498'398.29
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	533'212.92	498'398.29
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	186'624.52	174'439.40
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	346'588.40	323'958.89
Total	533'212.92	498'398.29
Klasse NTH1 CHF	31.01.2024	31.01.2023
Nettoertrag	72'299.44	146'168.44
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	72'299.44	146'168.44
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	25'304.80	51'158.95
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	46'994.64	95'009.49
Total	72'299.44	146'168.44

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							13'942'803.13	65.38	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							13'942'701.20	65.38	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	586	0	168	418 EUR	40.05	15'599.81	0.07	a)
AT0000743059	OMV AG	164	0	0	164 EUR	41.31	6'313.05	0.03	a)
AT0000746409	VERBUND AG	115	0	0	115 EUR	75.65	8'106.76	0.04	a)
AT0000937503	VOESTALPINE AG	250	0	0	250 EUR	27.60	6'429.68	0.03	a)
AT							36'449.30	0.17	
BE0003470755	SOLVAY SA	99	0	99	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003565737	KBC GROUP NV	427	0	110	317 EUR	60.48	17'865.35	0.08	a)
BE0003604155	LOTUS BAKERIES	0	1	0	1 EUR	7'890.00	7'352.20	0.03	a)
BE0003717312	SOFINA	42	0	32	10 EUR	222.60	2'074.27	0.01	a)
BE0003739530	UCB SA	215	0	80	135 EUR	87.30	10'982.18	0.05	a)
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	190	0	97	93 EUR	70.40	6'100.93	0.03	a)
BE0003822393	ELIA GROUP SA/NV	53	0	0	53 EUR	111.80	5'521.51	0.03	a)
BE0974259880	D'IETEREN GROUP	40	0	0	40 EUR	187.70	6'996.24	0.03	a)
BE0974264930	AGEAS	304	0	0	304 EUR	39.81	11'277.33	0.05	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1'421	0	114	1'307 EUR	57.51	70'042.13	0.33	a)
BE0974320526	UMICORE	334	0	0	334 EUR	21.17	6'588.82	0.03	a)
BE0974349814	WAREHOUSES DE PAUW SCA	241	6	0	247 EUR	27.28	6'278.87	0.03	a)
BE0974464977	SYENSQO SA	0	99	0	99 EUR	82.49	7'609.86	0.04	a)
BE							158'689.69	0.74	
BMG0112X1056	AEGON LTD	0	3'143	1'211	1'932 USD	5.94	9'836.90	0.05	a)
BM							9'836.90	0.05	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	1'116	0	468	648 CAD	20.88	8'687.49	0.04	a)
CA0084741085	AGNICO EAGLE MINES LTD	703	142	145	700 CAD	66.08	29'700.02	0.14	a)
CA0089118776	AIR CANADA	296	0	0	296 CAD	18.22	3'462.81	0.02	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	984	0	0	984 CAD	7.97	5'035.49	0.02	a)
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1'364	0	134	1'230 CAD	78.78	62'217.10	0.29	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	468	0	0	468 CAD	27.95	8'398.78	0.04	a)
CA05534B7604	BCE INC	117	0	0	117 CAD	54.25	4'075.44	0.02	a)
CA05577W2004	BRP INC/CA- SUB VOTING	86	0	0	86 CAD	84.84	4'684.76	0.02	a)
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	1'090	0	0	1'090 CAD	126.64	88'631.08	0.42	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	1'936	171	356	1'751 CAD	62.87	70'683.53	0.33	a)
CA0679011084	BARRICK GOLD CORP	2'945	500	907	2'538 CAD	21.00	34'221.54	0.16	a)
CA11271J1075	BROOKFIELD CORP	2'452	0	427	2'025 CAD	53.36	69'379.23	0.33	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	613	0	183	430 CAD	54.06	14'925.65	0.07	a)
CA1247651088	CAE INC	515	0	0	515 CAD	26.92	8'901.66	0.04	a)
CA1249003098	CCL INDUSTRIES INC - CL B	245	0	0	245 CAD	57.54	9'051.58	0.04	a)
CA12532H1047	CGI INC	339	0	0	339 CAD	150.56	32'771.62	0.15	a)
CA13321L1085	CAMECO CORP	685	0	0	685 CAD	64.19	28'232.32	0.13	a)
CA1349211054	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	139	0	0	139 CAD	46.67	4'165.25	0.02	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1'486	0	156	1'330 CAD	60.76	51'886.94	0.24	a)
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	972	0	153	819 CAD	166.78	87'703.42	0.41	a)
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	1'873	0	229	1'644 CAD	86.04	90'821.96	0.43	a)
CA13645T1003	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1'569	0	1'569	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA13646K1084	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	0	1'569	202	1'367 CAD	108.19	94'960.78	0.45	a)
CA1366812024	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	98	0	0	98 CAD	142.90	8'991.81	0.04	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	188	0	0	188 CAD	30.64	3'698.58	0.02	a)
CA15135U1093	CENOVUS ENERGY INC	2'233	0	0	2'233 CAD	21.78	31'227.36	0.15	a)
CA21037X1006	CONSTELLATION SOFTWARE INC	33	2	6	29 CAD	3'715.86	69'190.42	0.32	a)
CA2499061083	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	0	127	0	127 CAD	117.72	9'599.37	0.05	a)
CA25675T1075	DOLLARAMA INC	492	0	98	394 CAD	98.67	24'961.46	0.12	a)
CA2861812014	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	0	607	0	607 CAD	22.68	8'839.35	0.04	a)
CA2908761018	EMERA INC	421	0	0	421 CAD	47.51	12'842.68	0.06	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA2918434077	EMPIRE CO LTD 'A'	257	0	0	257 CAD	34.84	5'749.10	0.03	a)
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	3'447	231	595	3'083 CAD	47.74	94'502.78	0.44	a)
CA3039011026	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	42	0	13	29 CAD	1'401.47	26'095.79	0.12	a)
CA3359341052	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	1'027	0	0	1'027 CAD	12.20	8'044.87	0.04	a)
CA33767E2024	FIRSTSERVICE CORP	93	0	51	42 CAD	225.02	6'068.19	0.03	a)
CA3495531079	FORTIS INC	793	0	0	793 CAD	53.94	27'464.57	0.13	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	354	0	87	267 CAD	145.46	24'936.96	0.12	a)
CA36168Q1046	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	264	143	0	407 CAD	45.68	11'937.38	0.06	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	191	312	172	331 CAD	44.40	9'436.25	0.04	a)
CA39138C1068	GREAT-WEST LIFECO INC	481	0	0	481 CAD	44.88	13'860.74	0.06	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	406	0	0	406 CAD	39.90	10'401.30	0.05	a)
CA4495861060	IGM FINANCIAL INC	190	0	0	190 CAD	36.37	4'436.96	0.02	a)
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	179	0	0	179 CAD	91.40	10'504.80	0.05	a)
CA4530384086	IMPERIAL OIL LTD	348	0	128	220 CAD	77.55	10'954.51	0.05	a)
CA45823T1066	INTACT FINANCIAL CORP	299	0	46	253 CAD	210.25	34'154.28	0.16	a)
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	1'003	0	0	1'003 CAD	14.11	9'086.92	0.04	a)
CA4932711001	KEYERA CORP	379	0	0	379 CAD	32.52	7'913.68	0.04	a)
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	2'055	0	0	2'055 CAD	7.41	9'777.29	0.05	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	309	0	88	221 CAD	134.35	19'064.20	0.09	a)
CA55027C1068	LUMINE GROUP INC	0	99	99	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA5503721063	LUNDIN MINING CORP	472	593	0	1'065 CAD	10.98	7'508.28	0.04	a)
CA5527041084	MEG ENERGY CORP	0	477	0	477 CAD	25.42	7'785.43	0.04	a)
CA5592224011	MAGNA INTERNATIONAL INC	499	0	151	348 CAD	76.41	17'073.32	0.08	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	3'361	0	785	2'576 CAD	29.72	49'156.77	0.23	a)
CA59162N1096	METRO INC/CN	423	0	138	285 CAD	70.59	12'917.45	0.06	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	542	0	0	542 CAD	102.83	35'785.56	0.17	a)
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	344	470	500	314 CAD	24.74	4'987.90	0.02	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	961	0	268	693 CAD	67.04	29'830.18	0.14	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	118	0	118	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA68272K1030	ONEX CORPORATION	55	0	0	55 CAD	99.27	3'505.66	0.02	a)
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	446	0	0	446 CAD	58.63	16'789.72	0.08	a)
CA6979001089	PAN AMERICAN SILVER CORP	379	252	0	631 CAD	18.20	7'373.77	0.03	a)
CA70137W1086	PARKLAND CORP	262	0	0	262 CAD	45.88	7'718.15	0.04	a)
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	882	0	0	882 CAD	46.31	26'226.00	0.12	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	958	0	251	707 CAD	39.19	17'790.30	0.08	a)
CA7481932084	QUEBECOR INC -CL B	331	0	0	331 CAD	32.69	6'947.55	0.03	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	324	112	212 CAD	86.06	11'714.56	0.05	a)
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	491	0	94	397 CAD	104.95	26'752.33	0.13	a)
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	282	0	0	282 CAD	18.29	3'311.70	0.02	a)
CA7677441056	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	183	0	183	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	601	0	150	451 CAD	62.80	18'185.48	0.09	a)
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	2'298	0	197	2'101 CAD	131.21	177'003.41	0.83	a)
CA8029121057	SAPUTO INC	441	0	0	441 CAD	27.72	7'849.11	0.04	a)
CA82028K2002	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	760	0	760	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA82509L1076	SHOPIFY INC - CLASS A	2'024	203	464	1'763 CAD	107.63	121'835.62	0.57	a)
CA85472N1096	STANTEC INC	0	191	0	191 CAD	108.03	13'248.49	0.06	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	1'066	0	154	912 CAD	69.69	40'808.81	0.19	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	2'354	0	450	1'904 CAD	44.52	54'426.54	0.26	a)
CA87241L1094	TFI INTERNATIONAL INC	140	0	0	140 CAD	176.69	15'882.86	0.07	a)
CA87262K1057	TMX GROUP LTD	94	470	94	470 CAD	33.25	10'034.09	0.05	a)
CA87807B1076	TC ENERGY CORP	1'648	0	184	1'464 CAD	53.04	49'857.81	0.23	a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	793	0	186	607 CAD	53.81	20'972.02	0.10	a)
CA87971M9969	TELUS CORP-W/I	697	0	0	697 CAD	24.08	10'776.50	0.05	a)
CA8849037095	THOMSON REUTERS CORP	298	0	298	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8849038085	THOMSON REUTERS CORP	0	298	60	238 CAD	199.61	30'503.37	0.14	a)
CA8911021050	TOROMONT INDUSTRIES LTD	156	0	83	73 CAD	117.76	5'519.62	0.03	a)
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	3'065	0	360	2'705 CAD	81.67	141'846.45	0.67	a)
CA89156V1067	TOURMALINE OIL CORP	523	0	0	523 CAD	58.13	19'520.49	0.09	a)
CA92938W2022	WSP GLOBAL INC	200	0	0	200 CAD	197.51	25'363.41	0.12	a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	156	0	102	54 CAD	106.91	3'706.81	0.02	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	128	0	57	71 CAD	171.30	7'809.16	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA9628791027	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	795	0	155	640 CAD	63.01	25'892.75	0.12	a)
CA							2'420'557.48	11.35	
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	365	0	0	365 GBP	2'328.00	9'282.59	0.04	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	0	287	0	287 EUR	98.08	26'230.27	0.12	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	1'175	146	267	1'054 EUR	40.92	40'184.96	0.19	a)
CH							75'697.82	0.35	
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	139	0	139	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	3'561	0	655	2'906 EUR	12.03	32'587.12	0.15	a)
DE0005158703	BECHTLE AG	0	0	0	129 EUR	48.34	5'810.81	0.03	a)
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	515	0	0	515 EUR	96.78	46'444.39	0.22	a)
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	156	0	120	36 EUR	90.75	3'044.31	0.01	a)
DE0005200000	BEIERSDORF AG	190	0	56	134 EUR	135.85	16'963.08	0.08	a)
DE0005313704	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	68	27	72	23 EUR	98.56	2'112.36	0.01	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	188	0	0	188 EUR	76.20	13'349.14	0.06	a)
DE0005552004	DHL GROUP	1'643	0	164	1'479 EUR	44.52	61'356.94	0.29	a)
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	5'311	440	683	5'068 EUR	22.75	107'414.51	0.50	a)
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	717	0	0	717 EUR	26.12	17'451.50	0.08	a)
DE0005785802	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	355	0	0	355 EUR	36.00	11'908.89	0.06	a)
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	313	0	35	278 EUR	184.75	47'859.66	0.22	a)
DE0006047004	HEIDELBERG MATERIALS AG	256	0	79	177 EUR	85.88	14'164.64	0.07	a)
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	236	0	78	158 EUR	63.36	9'328.52	0.04	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	257	0	0	257 EUR	71.10	17'027.19	0.08	a)
DE0006062144	COVESTRO AG	334	0	0	334 EUR	49.08	15'275.36	0.07	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2'129	326	558	1'897 EUR	33.75	59'650.92	0.28	a)
DE0006452907	NEMETSCHKE SE	91	0	0	91 EUR	86.02	7'294.26	0.03	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	228	0	45	183 EUR	152.40	25'988.21	0.12	a)
DE0006602006	GEA GROUP AG	259	0	0	259 EUR	37.20	8'978.07	0.04	a)
DE0006969603	PUMA SE	180	0	0	180 EUR	37.60	6'306.68	0.03	a)
DE0007010803	RATIONAL AG	9	0	0	9 EUR	714.00	5'987.99	0.03	a)
DE0007030009	RHEINMETALL AG	70	0	0	70 EUR	324.80	21'186.27	0.10	a)
DE0007037129	RWE AG	966	0	0	966 EUR	34.33	30'902.34	0.14	a)
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	1'311	130	272	1'169 EUR	62.85	68'463.67	0.32	a)
DE0007164600	SAP SE	1'711	50	203	1'558 EUR	160.80	233'450.00	1.09	a)
DE0007165631	SARTORIUS AG-VORZUG	45	0	0	45 EUR	340.90	14'294.86	0.07	a)
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	1'298	0	175	1'123 EUR	166.68	174'422.95	0.82	a)
DE0007664005	VOLKSWAGEN AG	60	0	0	60 EUR	131.60	7'357.79	0.03	a)
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	266	78	77	267 EUR	119.84	29'816.28	0.14	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1'069	0	0	1'069 EUR	7.75	7'718.05	0.04	a)
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	106	0	29	77 EUR	222.20	15'943.19	0.07	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	697	0	90	607 EUR	247.80	140'162.03	0.66	a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	232	24	49	207 EUR	394.20	76'037.42	0.36	a)
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES AG	89	0	0	89 EUR	213.70	17'722.91	0.08	a)
DE000A12DM80	SCOUT24 SE	130	0	38	92 EUR	68.42	5'865.58	0.03	a)
DE000A161408	HELLOFRESH SE	278	0	0	278 EUR	12.37	3'204.46	0.02	a)
DE000A1DAH00	BRENTAG SE	263	0	89	174 EUR	82.26	13'337.62	0.06	a)
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	262	0	40	222 EUR	176.12	36'433.60	0.17	a)
DE000A1J5RX9	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	2'389	0	2'389	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1ML7J1	VONOVIA SE	1'287	0	243	1'044 EUR	29.05	28'260.97	0.13	a)
DE000A2E4K43	DELIVERY HERO SE	275	0	0	275 EUR	21.30	5'458.24	0.03	a)
DE000BASF111	BASF SE	1'586	0	318	1'268 EUR	44.46	52'532.62	0.25	a)
DE000BAY0017	BAYER AG-REG	1'681	0	224	1'457 EUR	28.90	39'237.18	0.18	a)
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	1'671	0	254	1'417 EUR	10.68	14'102.03	0.07	a)
DE000DTR0CK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	711	216	212	715 EUR	33.26	22'159.94	0.10	a)
DE000ENAG999	E.ON SE	3'869	0	644	3'225 EUR	12.56	37'745.03	0.18	a)
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	685	0	0	685 EUR	13.97	8'913.99	0.04	a)
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	363	0	0	363 EUR	17.15	5'799.42	0.03	a)
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	129	0	0	129 EUR	57.54	6'916.72	0.03	a)
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	131	0	0	131 EUR	77.46	9'455.60	0.04	a)
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	191	0	0	191 EUR	79.12	14'081.86	0.07	a)
DE000PAH0038	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	264	0	0	264 EUR	46.50	11'439.24	0.05	a)
DE000SHL1006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	486	0	126	360 EUR	51.86	17'397.04	0.08	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
DE000SYM9999	SYMRISE AG	200	0	0	200 EUR	95.94	17'880.11	0.08	a)
DE000TLX1005	TALANX AG	0	106	42	64 EUR	65.05	3'879.43	0.02	a)
DE000WCH8881	WACKER CHEMIE AG	0	30	0	30 EUR	101.45	2'836.05	0.01	a)
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	378	0	0	378 EUR	18.68	6'579.74	0.03	a)
LU1673108939	AROUNDTOWN SA	1'566	0	1'566	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE							1'737'298.78	8.15	
DK0010181759	CARLSBERG AS-B	143	0	0	143 DKK	889.20	15'896.77	0.07	a)
DK0010219153	ROCKWOOL A/S-B SHS	14	0	0	14 DKK	1'890.00	3'307.98	0.02	a)
DK0010244425	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	3	0	0	3 DKK	12'510.00	4'691.93	0.02	a)
DK0010244508	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	11	0	4	7 DKK	12'725.00	11'136.00	0.05	a)
DK0010272202	GENMAB A/S	101	22	34	89 DKK	1'921.00	21'374.24	0.10	a)
DK0010274414	DANSKE BANK A/S	1'131	0	0	1'131 DKK	185.65	26'250.09	0.12	a)
DK0060079531	DSV A/S	326	0	48	278 DKK	1'237.50	43'009.39	0.20	a)
DK0060094928	ORSTED A/S	379	0	148	231 DKK	391.50	11'306.21	0.05	a)
DK0060227585	CHR HANSEN HOLDING A/S	168	0	168	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	171	0	25	146 DKK	1'009.00	18'416.93	0.09	a)
DK0060336014	NOVOZYMES A/S-B SHARES	344	257	0	601 DKK	354.30	26'620.67	0.12	a)
DK0060448595	COLOPLAST-B	201	0	0	201 DKK	797.60	20'042.62	0.09	a)
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	2'787	44	2'831	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060636678	TRYG A/S	601	0	0	601 DKK	147.55	11'086.31	0.05	a)
DK0060738599	WILLIAM DEMANT HOLDING	180	0	0	180 DKK	313.80	7'061.53	0.03	a)
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1'648	0	259	1'389 DKK	196.66	34'150.07	0.16	a)
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	0	5'662	841	4'821 DKK	774.80	466'981.91	2.19	a)
DK							721'332.65	3.38	
ES0105046009	AENA SME SA	130	0	0	130 EUR	164.25	19'897.07	0.09	a)
ES0105066007	CELLNEX TELECOM SA	872	0	0	872 EUR	35.78	29'073.49	0.14	a)
ES0105563003	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	0	113	0	113 EUR	24.10	2'537.67	0.01	a)
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	731	0	101	630 EUR	65.06	38'193.99	0.18	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	10'894	0	2'008	8'886 EUR	8.68	71'839.99	0.34	a)
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	27'360	0	3'404	23'956 EUR	3.74	83'387.98	0.39	a)
ES0116870314	NATURGY ENERGY GROUP SA	339	0	259	80 EUR	25.00	1'863.68	0.01	a)
ES0118900010	FERROVIAL SA	606	0	606	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0125220311	ACCIONA SA	40	0	0	40 EUR	120.25	4'482.14	0.02	a)
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	505	6	0	511 EUR	15.05	7'166.35	0.03	a)
ES0127797027	EDP RENOVAVEIS SA - INTERIM	0	6	6	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0130670112	ENDESA SA	548	0	0	548 EUR	18.36	9'375.48	0.04	a)
ES0130960018	ENAGAS SA	457	0	0	457 EUR	15.09	6'426.08	0.03	a)
ES0140609019	CAIXABANK SA	7'813	0	867	6'946 EUR	3.95	25'592.44	0.12	a)
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	10'095	445	1'281	9'259 EUR	11.18	96'416.65	0.45	a)
ES0144583285	IBERDROLA SA-INTERIM	0	277	277	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144583293	IBERDROLA SA	0	170	0	170 EUR	11.18	1'770.26	0.01	a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	1'953	0	375	1'578 EUR	39.71	58'391.18	0.27	a)
ES0167050238	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	0	7	7	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050246	ACS ACTIVIDADES DE CON-SCRIP	0	23	23	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050915	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	456	30	202	284 EUR	36.59	9'683.25	0.05	a)
ES0171996087	GRIFOLS SA	497	0	0	497 EUR	10.15	4'698.39	0.02	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	750	0	441	309 EUR	15.43	4'442.88	0.02	a)
ES0173516115	REPSOL SA	2'452	262	1'100	1'614 EUR	13.74	20'664.77	0.10	a)
ES0178430E18	TELEFONICA SA	8'384	0	1'735	6'649 EUR	3.77	23'358.13	0.11	a)
ES							519'261.87	2.43	
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	455	0	0	455 EUR	18.08	7'665.67	0.04	a)
FI0009000681	NOKIA OYJ	9'190	0	2'113	7'077 EUR	3.32	21'907.31	0.10	a)
FI0009003305	SAMPO OYJ-A SHS	878	0	878	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	870	0	0	870 EUR	13.70	11'106.58	0.05	a)
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	1'025	0	0	1'025 EUR	11.82	11'284.91	0.05	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	938	0	196	742 EUR	33.67	23'280.24	0.11	a)
FI0009007132	FORTUM OYJ	756	0	0	756 EUR	12.69	8'939.72	0.04	a)
FI0009007884	ELISA OYJ	230	0	0	230 EUR	42.25	9'055.14	0.04	a)
FI0009013296	NESTE OYJ	732	0	210	522 EUR	32.05	15'589.74	0.07	a)
FI0009013403	KONE OYJ-B	600	0	154	446 EUR	45.94	19'092.65	0.09	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	82	210	128	164 EUR	42.72	6'528.53	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FI0009014575	METSO OUTOTEC OYJ	0	999	0	999 EUR	9.29	8'648.12	0.04	a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	6'005	0	1'284	4'721 SEK	128.26	50'274.13	0.24	a)
FI4000552500	SAMPO OYJ-A SHS	0	878	182	696 EUR	38.79	25'154.37	0.12	a)
FI4000552526	MANDATUM OYJ	0	878	878	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI							218'527.11	1.02	
FR0000039299	BOLLORE SE	1'417	0	1'417	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	2'164	0	562	1'602 EUR	13.31	19'872.21	0.09	a)
FR0000051807	TELEPERFORMANCE	103	0	0	103 EUR	145.65	13'979.39	0.07	a)
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	54	0	8	46 EUR	1'957.80	83'920.21	0.39	a)
FR0000054470	UBISOFT ENTERTAINMENT	125	0	125	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000064578	COVIVIO	76	6	0	82 EUR	45.16	3'450.71	0.02	a)
FR0000073272	SARFRAN SA	560	0	52	508 EUR	173.42	82'092.46	0.38	a)
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	836	58	128	766 EUR	173.68	123'970.67	0.58	a)
FR0000120172	CARREFOUR SA	875	0	0	875 EUR	15.82	12'898.97	0.06	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	4'167	0	748	3'419 EUR	60.10	191'475.83	0.90	a)
FR0000120321	L'OREAL	401	18	57	362 EUR	444.70	150'008.57	0.70	a)
FR0000120404	ACCOR SA	291	0	0	291 EUR	36.70	9'951.75	0.05	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	404	0	124	280 EUR	33.98	8'865.88	0.04	a)
FR0000120578	SANOFI	1'857	96	267	1'686 EUR	93.36	146'675.91	0.69	a)
FR0000120628	AXA SA	3'264	0	545	2'719 EUR	31.16	78'949.07	0.37	a)
FR0000120644	DANONE	1'078	0	128	950 EUR	61.74	54'655.09	0.26	a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	347	0	50	297 EUR	152.50	42'205.27	0.20	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	461	9	61	409 EUR	773.60	294'835.76	1.38	a)
FR0000121121	EURAZEO SE	90	0	0	90 EUR	79.05	6'629.56	0.03	a)
FR0000121204	WENDEL	45	0	45	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121220	SODEXO SA	151	0	0	151 EUR	104.60	14'718.01	0.07	a)
FR0000121329	THALES SA	193	0	49	144 EUR	135.35	18'161.89	0.09	a)
FR0000121485	KERING	122	14	37	99 EUR	383.25	35'355.56	0.17	a)
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	485	10	55	440 EUR	182.30	74'744.58	0.35	a)
FR0000121709	SEB SA	48	0	0	48 EUR	113.50	5'076.65	0.02	a)
FR0000121964	KLEPIERRE	351	0	0	351 EUR	24.09	7'879.24	0.04	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	931	0	126	805 EUR	182.90	137'198.69	0.64	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	1'314	0	267	1'047 EUR	30.27	29'532.45	0.14	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	836	0	133	703 EUR	65.84	43'130.60	0.20	a)
FR0000125338	CAPGEMINI SE	259	0	33	226 EUR	207.20	43'635.36	0.20	a)
FR0000125486	VINCI SA	908	0	149	759 EUR	117.08	82'806.58	0.39	a)
FR0000127771	VIVENDI SE	1'319	0	0	1'319 EUR	10.46	12'850.18	0.06	a)
FR0000130395	REMY COINTREAU	39	0	0	39 EUR	94.28	3'426.29	0.02	a)
FR0000130452	EIFFAGE	153	0	73	80 EUR	97.08	7'237.03	0.03	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	382	0	39	343 EUR	93.10	29'756.66	0.14	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	1'271	0	283	988 EUR	23.96	22'058.91	0.10	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	1'891	0	358	1'533 EUR	62.55	89'353.15	0.42	a)
FR0000131906	RENAULT SA	332	0	0	332 EUR	35.07	10'849.61	0.05	a)
FR0000133308	ORANGE	3'733	0	1'022	2'711 EUR	11.00	27'783.29	0.13	a)
FR0004125920	AMUNDI SA	37	0	0	37 EUR	62.90	2'168.67	0.01	a)
FR0006174348	BUREAU VERITAS SA	536	0	275	261 EUR	24.70	6'007.28	0.03	a)
FR0010040865	GECINA SA	45	0	0	45 EUR	102.70	4'306.49	0.02	a)
FR0010208488	ENGIE	3'148	0	466	2'682 EUR	14.81	37'012.99	0.17	a)
FR0010220475	ALSTOM	547	6	0	553 EUR	11.75	6'054.85	0.03	a)
FR0010242511	EDF	988	0	988	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010259150	IPSEN	65	0	0	65 EUR	107.00	6'480.93	0.03	a)
FR0010307819	LEGRAND SA	463	0	85	378 EUR	90.24	31'785.66	0.15	a)
FR0010313833	ARKEMA	103	0	0	103 EUR	101.30	9'722.70	0.05	a)
FR0010340141	ADP	48	0	0	48 EUR	124.40	5'564.19	0.03	a)
FR0010533075	GETLINK SE	742	0	408	334 EUR	16.00	4'979.74	0.02	a)
FR0010908533	EDENRED	416	0	0	416 EUR	55.42	21'483.26	0.10	a)
FR0011981968	WORLDLINE SA	398	0	0	398 EUR	12.62	4'678.54	0.02	a)
FR0013154002	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	47	0	0	47 EUR	251.20	11'001.65	0.05	a)
FR0013176526	VALEO	391	0	391	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013280286	BIOMERIEUX	71	0	0	71 EUR	100.00	6'616.05	0.03	a)
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	145	0	0	145 EUR	66.98	9'050.10	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	169	0	0	169 EUR	37.64	5'927.57	0.03	a)
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	1'052	199	318	933 EUR	48.24	41'935.74	0.20	a)
FR0014004L86	DASSAULT AVIATION SA	17	30	0	47 EUR	175.50	7'686.27	0.04	a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	1'072	0	0	1'072 EUR	30.82	30'787.03	0.14	a)
NL0000235190	AIRBUS SE	1'003	0	125	878 EUR	147.80	120'923.12	0.57	a)
FR							2'394'164.87	11.23	
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	659	0	0	659 GBP	1'735.00	12'490.45	0.06	a)
GB0000536739	ASHTAD GROUP PLC	689	0	57	632 GBP	5'202.00	35'915.40	0.17	a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1'736	0	0	1'736 GBP	540.40	10'248.45	0.05	a)
GB0001367019	BRITISH LAND CO PLC	1'485	0	1'485	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0002374006	DIAGEO PLC	3'783	0	465	3'318 GBP	2'860.50	103'683.96	0.49	a)
GB0002634946	BAE SYSTEMS PLC	5'456	295	1'122	4'629 GBP	1'177.00	59'519.17	0.28	a)
GB0002875804	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3'488	287	682	3'093 GBP	2'338.50	79'015.19	0.37	a)
GB0004052071	HALMA PLC	646	0	0	646 GBP	2'193.00	15'476.20	0.07	a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	4'484	0	1'447	3'037 GBP	598.80	19'866.43	0.09	a)
GB0004544929	IMPERIAL BRANDS PLC	1'654	0	338	1'316 GBP	1'898.50	27'293.53	0.13	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	34'055	0	5'257	28'798 GBP	618.20	194'484.32	0.91	a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	8'941	0	0	8'941 GBP	255.00	24'906.89	0.12	a)
GB0006731235	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	669	0	251	418 GBP	2'341.00	10'689.83	0.05	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	1'288	0	594	694 GBP	971.60	7'366.14	0.03	a)
GB0006825383	PERSIMMON PLC	558	0	0	558 GBP	1'463.00	8'918.09	0.04	a)
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	4'843	0	769	4'074 GBP	818.40	36'423.36	0.17	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	1'892	0	241	1'651 GBP	5'503.00	99'252.13	0.47	a)
GB0007669376	ST JAMES'S PLACE PLC	892	0	0	892 GBP	654.20	6'374.83	0.03	a)
GB0007908733	SSE PLC	1'791	0	320	1'471 GBP	1'685.00	27'077.33	0.13	a)
GB0007980591	BP PLC	31'449	0	6'050	25'399 GBP	462.45	128'314.19	0.60	a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	113'853	0	14'873	98'980 GBP	42.54	45'992.51	0.22	a)
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	6'204	0	0	6'204 GBP	148.20	10'044.15	0.05	a)
GB0009223206	SMITH & NEPHEW PLC	1'506	0	512	994 GBP	1'110.50	12'058.64	0.06	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	2'572	81	357	2'296 GBP	10'500.00	263'362.80	1.23	a)
GB0030913577	BT GROUP PLC	11'347	0	1'803	9'544 GBP	112.20	11'698.13	0.05	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	28'733	0	4'361	24'372 GBP	148.42	39'516.35	0.19	a)
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	282	0	0	282 GBP	4'493.00	13'841.36	0.06	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	707	0	0	707 GBP	1'308.00	10'102.30	0.05	a)
GB0032089863	NEXT PLC	237	0	77	160 GBP	8'468.00	14'801.10	0.07	a)
GB0033195214	KINGFISHER PLC	3'725	0	0	3'725 GBP	220.40	8'968.73	0.04	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	2'916	0	0	2'916 GBP	270.20	8'607.28	0.04	a)
GB00B02J6398	ADMIRAL GROUP PLC	322	0	0	322 GBP	2'515.00	8'846.82	0.04	a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	0	9'573	2'132	7'441 GBP	138.45	11'254.27	0.05	a)
GB00B0744B38	BUNZL PLC	579	0	0	579 GBP	3'215.00	20'335.40	0.10	a)
GB00B082RF11	RENTOKIL INITIAL PLC	3'219	1'258	1'403	3'074 GBP	408.30	13'711.23	0.06	a)
GB00B05WJX34	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	542	112	62	592 GBP	8'942.00	57'829.52	0.27	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	4'317	0	580	3'737 GBP	3'847.00	157'050.22	0.74	a)
GB00B1FH8J72	SEVERN TRENT PLC	435	0	0	435 GBP	2'598.00	12'345.87	0.06	a)
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	349	0	159	190 GBP	3'596.00	7'463.91	0.03	a)
GB00B1VZ0M25	HARGREAVES LANSDOWN PLC	605	0	0	605 GBP	765.80	5'061.32	0.02	a)
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	674	0	278	396 GBP	1'622.50	7'018.97	0.03	a)
GB00B1XZ5820	ANGLO AMERICAN PLC	1'994	311	360	1'945 GBP	1'896.60	40'298.47	0.19	a)
GB00B1YW4409	3I GROUP PLC	1'643	0	241	1'402 GBP	2'479.00	37'968.01	0.18	a)
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1'239	0	166	1'073 GBP	5'708.00	66'907.83	0.31	a)
GB00B2B0DG97	RELX PLC	3'291	0	411	2'880 GBP	3'262.00	102'628.91	0.48	a)
GB00B39J2M42	UNITED UTILITIES GROUP PLC	1'192	0	0	1'192 GBP	1'066.50	13'887.70	0.07	a)
GB00B3MBS747	OCADO GROUP PLC	823	0	0	823 GBP	546.60	4'914.31	0.02	a)
GB00B5ZN1N88	SEGRO PLC	2'072	0	679	1'393 GBP	881.80	13'418.82	0.06	a)
GB00B63H8491	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	14'323	0	1'992	12'331 GBP	301.20	40'573.88	0.19	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	2'227	0	736	1'491 GBP	1'178.00	19'187.40	0.09	a)
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	2'963	0	298	2'665 GBP	2'178.00	63'408.63	0.30	a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNE	315	142	160	297 USD	68.90	17'554.44	0.08	a)
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	5'676	655	593	5'738 GBP	1'055.00	66'131.18	0.31	a)
GB00BF8Q6K64	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3'628	0	0	3'628 GBP	168.50	6'678.22	0.03	a)
GB00BGXQNP29	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	1'113	0	0	1'113 GBP	505.40	6'145.02	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	42'422	0	9'256	33'166	GBP	67.32	24'391.05	0.11 a)
GB00BHJYC057	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	360	0	106	254	GBP	7'500.00	20'810.77	0.10 a)
GB00BJFFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	242	0	0	242	GBP	4'805.00	12'702.87	0.06 a)
GB00BKFB1C65	M&G PLC	4'893	0	2'577	2'316	GBP	224.10	5'669.88	0.03 a)
GB00BL6K5J42	ENDEAVOUR MINING PLC	0	312	0	312	GBP	1'412.00	4'812.63	0.02 a)
GB00BL9YR756	WISE PLC - A	0	1'035	0	1'035	GBP	809.80	9'156.12	0.04 a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	11'770	0	1'901	9'869	GBP	286.60	30'898.86	0.14 a)
GB00BLJNL82	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	56	0	0	56	GBP	4'801.00	2'937.06	0.01 a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	8'335	0	0	8'335	GBP	225.20	20'505.35	0.10 a)
GB00BM8Q5M07	JD SPORTS FASHION PLC	1'167	4'211	0	5'378	GBP	117.05	6'876.79	0.03 a)
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	2'163	0	426	1'737	GBP	777.40	14'751.55	0.07 a)
GB00BMWC6P49	MONDI PLC	0	442	0	442	GBP	1'414.00	6'827.55	0.03 a)
GB00BMWRZ071	DOWLAIS GROUP PLC	0	2'433	2'433	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BMX86B70	HALEON PLC	8'187	0	0	8'187	GBP	321.50	28'754.06	0.13 a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	6'986	0	904	6'082	GBP	1'568.00	104'180.33	0.49 a)
GB00BNGDN821	MELROSE INDUSTRIES PLC	0	4'760	2'433	2'327	GBP	590.80	15'018.63	0.07 a)
GB00BNR5MZ78	MELROSE INDUSTRIES PLC	7'299	0	7'299	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	12'159	0	2'378	9'781	GBP	2'447.00	261'463.14	1.23 a)
GB00BP9LHF23	SCHRODERS PLC	1'306	0	0	1'306	GBP	406.20	5'795.30	0.03 a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	5'147	0	1'306	3'841	GBP	432.30	18'139.39	0.09 a)
GB00BVVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	1'505	0	0	1'505	GBP	728.80	11'982.24	0.06 a)
GB00BWFQ14	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	127	0	58	69	GBP	10'005.00	7'541.53	0.04 a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	1'209	0	0	1'209	GBP	669.60	8'843.72	0.04 a)
GB00BZ4BQC70	JOHNSON MATTHEY PLC	151	0	151	0	GBP	0.00	0.00	0.00
JE00B4T3BW64	GLENORE PLC	16'678	1'718	3'195	15'201	GBP	420.45	69'819.98	0.33 a)
JE00B8KF9B49	WPP PLC	2'020	0	781	1'239	GBP	771.40	10'441.05	0.05 a)
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	1'762	0	1'762	0	EUR	0.00	0.00	0.00
GB								2'849'249.44	13.36
CRH ID	CRH PLC	1'148	173	1'321	0	EUR	0.00	0.00	0.00
GB00B19NLV48	EXPERIAN PLC	1'440	0	177	1'263	GBP	3'296.00	45'476.16	0.21 a)
IE0001827041	CRH PLC	0	1'321	260	1'061	GBP	5'624.00	65'185.94	0.31 a)
IE0002424939	DCC PLC	171	0	0	171	GBP	5'756.00	10'752.52	0.05 a)
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	273	0	84	189	EUR	82.68	14'561.38	0.07 a)
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	265	0	49	216	EUR	75.56	15'208.49	0.07 a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	436	0	0	436	EUR	34.55	14'037.02	0.07 a)
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	0	1'797	0	1'797	EUR	8.53	14'286.94	0.07 a)
IE00BFOL3536	AIB GROUP PLC	0	2'248	0	2'248	EUR	4.08	8'538.29	0.04 a)
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	0	287	0	287	GBP	162.85	51'057.90	0.24 a)
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	287	0	287	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE								239'104.64	1.12
IL0002300114	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	4'117	0	4'117	0	ILS	0.00	0.00	0.00
IL0002730112	NICE LTD	120	0	34	86	ILS	75'210.00	15'252.69	0.07 a)
IL0002810146	ICL GROUP LTD	1'470	0	0	1'470	ILS	1'676.00	5'809.84	0.03 a)
IL0005930388	FIRST INTL BANK ISRAEL	0	86	86	0	ILS	0.00	0.00	0.00
IL0006046119	BANK LEUMI LE-ISRAEL	2'250	0	0	2'250	ILS	2'786.00	14'782.10	0.07 a)
IL0006625771	BANK HAPOALIM BM	1'671	0	0	1'671	ILS	3'118.00	12'286.41	0.06 a)
IL0006912120	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	2'907	0	1'168	1'739	ILS	1'778.00	7'291.28	0.03 a)
IL0006954379	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	176	0	0	176	ILS	13'630.00	5'656.93	0.03 a)
IL0010811243	ELBIT SYSTEMS LTD	41	0	0	41	ILS	75'300.00	7'280.34	0.03 a)
IL0010823792	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	177	0	177	0	ILS	0.00	0.00	0.00
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	183	0	47	136	USD	158.93	18'541.98	0.09 a)
IL0011194789	AZRIELI GROUP LTD	76	0	0	76	ILS	24'680.00	4'423.15	0.02 a)
IL0011301780	WIX.COM LTD	96	0	0	96	USD	126.88	10'449.02	0.05 a)
IL0011334468	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	68	0	0	68	USD	233.48	13'619.78	0.06 a)
IL0011741688	GLOBAL-E ONLINE LTD	0	155	0	155	USD	37.77	5'022.15	0.02 a)
IL0011762130	MONDAY.COM LTD	0	32	0	32	USD	210.04	5'765.85	0.03 a)
IL0065100930	ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	136	0	136	0	USD	0.00	0.00	0.00
US8816242098	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1'896	0	0	1'896	USD	12.10	19'680.45	0.09 a)
IL								145'861.97	0.68
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	990	0	0	990	GBP	968.20	10'471.13	0.05 a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IM							10'471.13	0.05	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	1'819	0	368	1'451 EUR	20.69	27'974.88	0.13	a)
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	1'045	0	0	1'045 EUR	12.30	11'977.38	0.06	a)
IT0000072170	FINCOBANK SPA	1'027	0	0	1'027 EUR	13.43	12'852.48	0.06	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	26'922	0	5'125	21'797 EUR	2.86	58'151.17	0.27	a)
IT0003128367	ENEL SPA	12'820	0	984	11'836 EUR	6.34	69'936.37	0.33	a)
IT0003132476	ENI SPA	4'146	0	481	3'665 EUR	14.81	50'592.57	0.24	a)
IT0003153415	SNAM SPA	3'471	0	0	3'471 EUR	4.53	14'648.64	0.07	a)
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	2'396	0	846	1'550 EUR	7.83	11'306.36	0.05	a)
IT0003492391	DIASORIN SPA	44	0	0	44 EUR	85.54	3'507.21	0.02	a)
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	15'916	0	0	15'916 EUR	0.28	4'136.40	0.02	a)
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	909	0	0	909 EUR	10.07	8'525.47	0.04	a)
IT0003828271	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	175	0	0	175 EUR	51.30	8'365.58	0.04	a)
IT0003856405	LEONARDO SPA	0	676	0	676 EUR	16.21	10'207.89	0.05	a)
IT0004056880	AMPLIFON SPA	216	0	0	216 EUR	30.37	6'112.78	0.03	a)
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	435	0	0	435 EUR	40.99	16'615.28	0.08	a)
IT0004965148	MONCLER SPA	356	0	0	356 EUR	57.30	19'008.38	0.09	a)
IT0005090300	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	508	0	0	508 EUR	11.25	5'323.09	0.02	a)
IT0005218380	BANCO BPM SPA	0	2'026	0	2'026 EUR	5.01	9'458.40	0.04	a)
IT0005239360	UNICREDIT SPA	3'648	0	1'296	2'352 EUR	27.16	59'526.11	0.28	a)
IT0005366767	NEXI SPA	1'158	0	0	1'158 EUR	7.14	7'708.86	0.04	a)
NL0011585146	FERRARI NV	218	0	44	174 EUR	323.70	52'484.65	0.25	a)
NL0015435975	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	862	0	0	862 EUR	9.41	7'558.53	0.04	a)
IT							475'978.48	2.23	
GB00B0LCW083	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	283	0	0	283 GBP	1'931.50	5'971.38	0.03	a)
JO							5'971.38	0.03	
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC	228	0	0	228 EUR	56.10	11'918.95	0.06	a)
LU0156801721	TENARIS SA	968	0	968	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
LU1598757687	ARCELORMITTAL	918	0	278	640 EUR	25.64	15'291.09	0.07	a)
LU2598331598	TENARIS SA	0	968	454	514 EUR	14.72	7'047.97	0.03	a)
LU							34'258.01	0.16	
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	185	0	0	185 EUR	77.85	13'420.56	0.06	a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	5'396	0	0	5'396 EUR	3.15	15'828.77	0.07	a)
NL0000009165	HEINEKEN NV	417	59	72	404 EUR	93.30	35'123.95	0.16	a)
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	1'523	68	349	1'242 EUR	19.78	22'887.61	0.11	a)
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	287	0	287	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000303709	AEGON NV	3'143	0	3'143	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000334118	ASM INTERNATIONAL NV	79	7	15	71 EUR	516.20	34'152.05	0.16	a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	200	0	0	200 EUR	52.76	9'832.75	0.05	a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	467	0	105	362 EUR	136.50	46'044.91	0.22	a)
NL0006294274	EURONEXT NV	146	0	0	146 EUR	81.65	11'108.35	0.05	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	682	12	95	599 EUR	798.20	445'532.03	2.09	a)
NL0010558797	OCI NV	171	0	0	171 EUR	26.62	4'241.74	0.02	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	481	43	227	297 EUR	38.04	10'527.79	0.05	a)
NL0010801007	IMCD NV	76	0	0	76 EUR	142.00	10'056.39	0.05	a)
NL0010832176	ARGENX SE	95	0	4	91 EUR	348.80	29'577.28	0.14	a)
NL0011540547	ABN AMRO BANK NV-CVA	731	0	0	731 EUR	13.66	9'304.83	0.04	a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1'625	0	257	1'368 EUR	26.01	33'156.36	0.16	a)
NL0011821202	ING GROEP NV	6'477	0	1'142	5'335 EUR	13.19	65'572.18	0.31	a)
NL0011872643	ASR NEDERLAND NV	0	275	0	275 EUR	43.71	11'200.92	0.05	a)
NL0012015705	JUST EAT TAKEAWAY	303	0	303	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012059018	EXOR NV	190	0	0	190 EUR	89.86	15'909.64	0.07	a)
NL0012169213	QIAGEN N.V.	386	0	386	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012866412	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	0	132	46	86 EUR	139.80	11'203.30	0.05	a)
NL0012969182	ADYEN NV	37	0	6	31 EUR	1'171.20	33'832.43	0.16	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	321	0	98	223 EUR	71.24	14'803.66	0.07	a)
NL0013654783	PROSUS NV	1'355	1'427	620	2'162 EUR	27.53	55'462.86	0.26	a)
NL0014332678	JDE PEET'S NV	227	0	0	227 EUR	22.86	4'835.51	0.02	a)
NL00150001Q9	STELLANTIS NV	3'574	0	419	3'155 EUR	20.50	60'254.25	0.28	a)
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	1'125	314	241	1'198 EUR	27.37	30'554.28	0.14	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
NL0015001F58	FERROVIAL SE	0	938	223	715 EUR	35.41	23'592.41	0.11	a)
NL0015001WM6	QIAGEN N.V.	0	220	0	220 EUR	40.41	8'283.20	0.04	a)
NL							1'066'300.01	5.00	
NO0003043309	KONGSBERG GRUPPEN ASA	266	90	318	38 NOK	537.00	1'674.09	0.01	a)
NO0003054108	MOWI ASA	795	0	0	795 NOK	189.80	12'378.96	0.06	a)
NO0003733800	ORKLA ASA	1'322	0	0	1'322 NOK	82.50	8'947.59	0.04	a)
NO0005052605	NORSK HYDRO ASA	2'267	0	0	2'267 NOK	61.94	11'519.76	0.05	a)
NO0010063308	TELENOR ASA	1'258	0	608	650 NOK	116.70	6'223.08	0.03	a)
NO0010096985	EQUINOR ASA	1'608	0	247	1'361 NOK	302.65	33'792.45	0.16	a)
NO0010161896	DNB BANK ASA	1'653	0	388	1'265 NOK	205.10	21'285.16	0.10	a)
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	299	0	0	299 NOK	349.40	8'570.67	0.04	a)
NO0010310956	SALMAR ASA	95	0	0	95 NOK	584.80	4'557.76	0.02	a)
NO0010345853	AKER BP ASA	537	0	0	537 NOK	280.80	12'370.64	0.06	a)
NO0010582521	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	327	0	0	327 NOK	169.70	4'552.50	0.02	a)
NO0010844038	ADEVINTA ASA-B	406	0	0	406 NOK	113.00	3'763.79	0.02	a)
NO							129'636.45	0.61	
PTEDP0AM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	4'963	0	0	4'963 EUR	4.14	19'155.56	0.09	a)
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	774	0	0	774 EUR	14.62	10'540.96	0.05	a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	475	0	0	475 EUR	21.08	9'330.49	0.04	a)
PT							39'027.01	0.18	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	1'219	0	471	748 SEK	147.48	9'158.98	0.04	a)
SE0000107203	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	138	0	0	138 SEK	327.90	3'756.93	0.02	a)
SE0000108227	SKF AB-B SHARES	731	211	451	491 SEK	205.90	8'393.63	0.04	a)
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	4'592	0	0	4'592 SEK	57.73	22'009.78	0.10	a)
SE0000108847	LUNDBERGS AB-B SHS	140	0	0	140 SEK	544.60	6'330.21	0.03	a)
SE0000112385	SAAB AB-B	0	134	0	134 SEK	672.80	7'485.19	0.04	a)
SE0000112724	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	1'033	0	0	1'033 SEK	142.05	12'182.99	0.06	a)
SE0000113250	SKANSKA AB-B SHS	587	0	0	587 SEK	181.15	8'828.54	0.04	a)
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	603	0	335	268 SEK	256.40	5'705.12	0.03	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	2'307	0	0	2'307 SEK	249.90	47'865.88	0.22	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	2'770	0	543	2'227 SEK	148.15	27'392.65	0.13	a)
SE0000163594	SECURITAS AB-B SHS	828	0	0	828 SEK	101.35	6'967.33	0.03	a)
SE0000190126	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	147	0	0	147 SEK	328.40	4'008.05	0.02	a)
SE0000202624	GETINGE AB-B SHS	387	0	0	387 SEK	223.70	7'187.69	0.03	a)
SE0000242455	SWEDBANK AB - A SHARES	1'543	0	267	1'276 SEK	212.80	22'544.18	0.11	a)
SE0000667891	SANDVIK AB	1'940	0	367	1'573 SEK	219.40	28'653.49	0.13	a)
SE0000667925	TELIA CO AB	3'548	0	0	3'548 SEK	26.88	7'918.18	0.04	a)
SE0000695876	ALFA LAVAL AB	530	0	202	328 SEK	384.10	10'459.97	0.05	a)
SE0000872095	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	431	224	351	304 SEK	292.00	7'370.02	0.03	a)
SE0001515552	INDUTRADE AB	444	0	0	444 SEK	254.30	9'374.36	0.04	a)
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	699	0	0	699 SEK	81.40	4'724.04	0.02	a)
SE0005127818	SAGAX AB-B	274	541	413	402 SEK	254.30	8'487.59	0.04	a)
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	803	0	0	803 SEK	88.86	5'924.26	0.03	a)
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	1'709	0	263	1'446 SEK	286.70	34'419.79	0.16	a)
SE0007100599	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	2'494	0	0	2'494 SEK	112.55	23'305.27	0.11	a)
SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B	1'056	0	302	754 SEK	244.70	15'318.55	0.07	a)
SE0010100958	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	246	0	0	246 SEK	263.10	5'373.64	0.03	a)
SE0011090018	HOLMEN AB-B SHARES	152	0	0	152 SEK	411.60	5'194.35	0.02	a)
SE0012673267	EVOLUTION AB	293	24	63	254 SEK	1'223.00	25'791.25	0.12	a)
SE0012853455	EQT AB	497	0	0	497 SEK	282.00	11'636.38	0.05	a)
SE0015658109	EPIROC AB-A	1'052	0	0	1'052 SEK	184.45	16'110.41	0.08	a)
SE0015658117	EPIROC AB-B	783	0	450	333 SEK	162.70	4'498.25	0.02	a)
SE0015810247	KINNEVIK AB - B	409	0	409	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015811955	INVESTOR AB-A SHS	902	0	902	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015811963	INVESTOR AB-B SHS	2'875	0	324	2'551 SEK	245.90	52'081.23	0.24	a)
SE0015949201	LIFCO AB-B SHS	249	0	0	249 SEK	252.20	5'213.83	0.02	a)
SE0015949748	BEIJER REF AB	0	567	0	567 SEK	142.80	6'722.39	0.03	a)
SE0015961909	HEXAGON AB-B SHS	3'096	847	676	3'267 SEK	114.00	30'921.90	0.14	a)
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	2'425	0	0	2'425 SEK	62.74	12'631.89	0.06	a)
SE0016589188	ELECTROLUX AB-B	374	0	374	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0016828511	EMBRACER GROUP AB	1'604	0	1'604	0 SEK	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
SE0016844831	VOLVO CAR AB-B	971	0	0	971 SEK	27.32	2'202.48	0.01	a)
SE0017486889	ATLAS COPCO AB-A SHS	4'268	0	0	4'268 SEK	166.95	59'159.31	0.28	a)
SE0017486897	ATLAS COPCO AB-B SHS	2'724	0	674	2'050 SEK	144.75	24'636.82	0.12	a)
SE0017768716	BOLIDEN AB	359	0	359	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0017832488	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1'116	0	0	1'116 SEK	69.94	6'480.40	0.03	a)
SE0020050417	BOLIDEN AB	0	359	0	359 SEK	276.95	8'254.83	0.04	a)
SE0020050425	BOLIDEN AB RED SHS	0	359	359	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0020846293	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM-BTA	0	61	61	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE							632'682.03	2.97	
CA11284V1058	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	213	0	0	213 CAD	37.56	5'136.81	0.02	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	262	0	0	262 USD	76.56	17'207.37	0.08	a)
US							22'344.18	0.10	
GB00B1CRLC47	MONDI PLC	885	0	885	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
ZA							0.00	0.00	
Bezugsrechte							101.93	0.00	
BE6343317028	WAREHOUSES DE PAUW CVA-SCRIP	0	241	241	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CA21037X1428	CONSTELLATION SOFTWARE-RTS	0	35	35	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
DE000A2GSYQ9	VONOVIA SE-SCRIP	0	1'287	1'287	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0627797907	EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	0	505	505	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809P3	IBERDROLA SA-RTS	10'080	0	10'080	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809Q1	IBERDROLA SA-RTS	0	10'263	10'263	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809R9	IBERDROLA SA-RTS	0	9'917	9'917	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509M2	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	406	0	406	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509N0	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	0	463	463	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509O8	ACS ACTIVIDADES DE CONS-RTS	0	284	26	258 EUR	0.42	101.93	0.00	a)
FR001400GCH7	ESSILORLUXOTTICA SA-SCRIP	0	485	485	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400HCY0	COVIVIO SA/FRANCE	0	76	76	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400IKH6	ALSTOM SA-SCRIP	0	547	547	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XR77	SHELL PLC-EEE AUG23	0	11'904	11'904	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XS84	SHELL PLC - EEE NOV23	0	11'223	11'223	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	0	12'159	12'159	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XV14	SHELL PLC-EEE MAY23	0	11'904	11'904	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001B69	ABN AMRO BANK NV	0	731	731	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	467	467	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001DZ8	UNIVERSAL MUSIC GROUP-SCRIP	0	1'125	1'125	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001E12	NN GROUP NV-SCRIP	0	481	481	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001FK5	ARCELORMITTAL SA	0	918	918	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001GE6	AEGON NV-DRIP	0	3'143	3'143	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001I05	FERROVIAL SE-SCRIP	0	606	606	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001L34	UNIVERSAL MUSIC GROUP N-DRIP	0	1'439	1'439	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LH9	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	467	467	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LR8	NN GROUP NV	0	508	508	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001LT4	ABN AMRO BANK NV	0	731	731	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001MH7	AEGON NV-DRIP	0	3'143	3'143	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001RN4	FERROVIAL SE-SCRIP	0	924	924	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001S86	ARCELORMITTAL SA	0	918	918	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
SE0020846285	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM-RTS	0	431	431	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
Diverse							101.93	0.00	
Wertpapiere, die an einem anderen gelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							7'072'378.65	33.16	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							7'072'378.65	33.16	
CH0117044807	SWC (CH) INDEX EF JAPAN NT	29'934	621	5'056	25'499 JPY	32'199.72	4'818'463.60	22.59	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	21'822	898	4'048	18'672 CHF	120.71	2'253'915.05	10.57	a)
CH							7'072'378.65	33.16	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Nicht kotierte Wertpapiere							0.01	0.00	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							0.01	0.00	
GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	774	0	0	774 GBP	0.00	0.01	0.00	c)
AE							0.01	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Optionen und Optionsscheine							0.00	0.00	
CA21037X1345	CONSTELLATION SOFTWARE --- WARRANT	0	35	0	35 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
Futures							0.00	0.00	
03/23	MINI TPX IDX FUT MAR23	6	1	7	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	4	1	5	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	MINI TPX IDX FUT JUN23	0	9	9	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
06/23	SPI 200 FUTURES JUN23	0	1	1	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	8	8	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	1	1	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/23	MINI TPX IDX FUT SEP23	0	8	8	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO STOXX 50 SEP23	0	7	7	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	FTSE 100 IDX FUT SEP23	0	1	1	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	MINI TPX IDX FUT DEC23	0	6	6	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	0	4	4	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	2	2	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	MINI TPX IDX FUT MAR24	0	5	0	5 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	4	1	3 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	1	0	1 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
Devisentermingeschäfte									
	CHF/EUR Verfall 08.05.2023		38'000	37'335	EUR/CHF		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'809'640	1'816'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		38'466	42'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.03.2023		155'758	1'331'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.03.2023		40'403	440'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.03.2023		10'066	17'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		1'191'332	168'520'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		443'871	687'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		71'817	103'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		154'898	1'156'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.03.2023		25'198	95'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		659'050	960'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		826'993	733'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		181'263	2'069'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		1'816'000	1'804'868	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.03.2023		1'156'000	154'372	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		733'000	831'669	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.03.2023		95'000	24'374	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.03.2023		440'000	39'855	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.03.2023		17'000	9'871	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.03.2023		2'069'000	185'920	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.03.2023		103'000	71'719	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.03.2023		1'331'000	158'937	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		168'520'000	1'159'434	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		960'000	660'941	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		687'000	434'246	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		42'000	39'365	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		1'860'396	1'875'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		164'022	1'230'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		857'412	758'000	CHF/GBP		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	ILS/CHF Verfall 04.04.2023		24'819	97'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		41'766	462'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.04.2023		11'571	20'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		191'119	2'131'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		70'123	101'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		146'686	1'231'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'179'693	171'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		657'352	958'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		427'516	678'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		40'155	43'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.04.2023		758'000	856'267	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.04.2023		97'000	24'611	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.04.2023		462'000	40'305	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.04.2023		101'000	69'398	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.04.2023		2'131'000	187'762	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.04.2023		958'000	646'727	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		43'000	39'280	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.04.2023		20'000	11'431	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.04.2023		1'231'000	143'248	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.04.2023		678'000	414'868	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.04.2023		1'230'000	163'873	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.04.2023		1'875'000	1'861'088	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.04.2023		171'300'000	1'175'923	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		815'792	724'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.05.2023		24'546	97'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		38'576	443'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		69'924	102'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		182'538	2'075'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		629'457	935'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		42'798	47'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.05.2023		11'965	21'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2023		144'292	1'242'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		409'713	671'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		170'047	1'278'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		1'848'355	1'865'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		1'175'252	171'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		8'932	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2023		8'342	1'208'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		6'767	10'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		3'386	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		19'747	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		5'270	8'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		4'901	37'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		2'435	28'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		5'590	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.05.2023		102'000	68'042	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		732'000	818'823	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		953'000	625'340	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2023		1'315'000	173'356	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		2'103'000	182'456	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2023		172'208'000	1'125'551	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		21'000	11'545	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		1'894'000	1'860'988	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.05.2023		97'000	23'742	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		47'000	41'836	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		671'000	394'642	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.05.2023		1'242'000	140'812	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.05.2023		443'000	36'875	NOK/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		846'661	759'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		641'209	980'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		173'758	1'320'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		188'942	2'182'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		1'170'952	179'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		11'504	21'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		1'896'031	1'933'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.06.2023		24'164	99'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		38'143	43'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		409'639	698'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		144'581	1'278'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		38'547	464'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		5'000	4'867	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		4'000	4'467	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		4'000	4'485	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		5'000	4'864	EUR/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		99'000	24'233	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		43'000	39'308	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.06.2023		21'000	11'506	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		1'923'000	1'874'213	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		104'000	70'171	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		980'000	659'119	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		751'000	850'951	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		698'000	412'965	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		179'000'000	1'171'090	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.06.2023		464'000	38'067	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.06.2023		1'278'000	149'251	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		1'320'000	172'735	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		2'182'000	183'288	SEK/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		69'189	104'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.07.2023		91'000	21'938	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.07.2023		948'000	640'895	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.07.2023		1'328'000	174'101	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2023		1'901'000	1'855'319	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.07.2023		42'000	37'575	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.07.2023		2'160'000	178'891	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.07.2023		101'000	66'767	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.07.2023		21'000	11'510	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.07.2023		728'000	827'962	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.07.2023		1'143'000	130'478	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.07.2023		679'000	404'331	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.07.2023		190'557'000	1'179'434	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.07.2023		442'000	36'911	NOK/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.07.2023		22'219	91'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		38'245	42'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.07.2023		11'460	21'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		1'859'940	1'912'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		69'319	103'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		639'031	953'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		826'839	732'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		409'528	694'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		1'268'279	193'612'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		37'735	461'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		138'315	1'188'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		173'502	1'328'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		181'068	2'160'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		11'000	10'711	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 05.07.2023		18'000	2'083	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		1'554'000	10'178	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.07.2023		5'000	3'356	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		4'000	4'539	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 05.07.2023		19'000	1'551	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.07.2023		4'000	2'378	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.07.2023		11'000	6'667	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		1'501'000	9'434	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 05.07.2023		2'000	1'335	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 05.07.2023		27'000	3'090	HKD/CHF		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		22'126	92'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		656'109	973'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		168'906	1'290'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		1'891'448	1'941'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		37'464	42'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		66'637	101'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		180'575	2'184'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		10'928	20'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		827'983	730'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		133'237	1'170'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		407'034	685'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		1'274'024	205'556'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		37'423	449'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.08.2023		449'000	38'470	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		685'000	400'109	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.08.2023		101'000	65'934	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		973'000	640'759	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.08.2023		92'000	21'767	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.08.2023		1'290'000	165'430	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.08.2023		1'170'000	130'043	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		205'556'000	1'254'056	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		2'184'000	180'158	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		1'941'000	1'855'014	EUR/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		730'000	814'125		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.08.2023		20'000	10'790		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		42'000	36'408		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.09.2023		1'302'000	167'450		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.09.2023		461'000	38'277		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.09.2023		98'000	22'789		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2023		727'000	415'873		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2023		2'214'000	178'603		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2023		2'027'000	1'943'184		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2023		1'018'000	664'550		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.09.2023		1'240'000	139'674		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2023		760'000	850'638		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.09.2023		112'000	73'254		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2023		21'000	11'045		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2023		207'800'000	1'260'639		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		43'000	37'978		USD/CHF	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		39'402	461'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		423'605	727'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		72'966	112'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		668'295	1'018'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		23'126	98'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		166'692	1'302'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		137'361	1'240'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		1'269'704	207'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		182'268	2'214'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		1'933'409	2'027'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		844'707	760'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		11'289	21'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		37'142	43'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		185'447	1'444'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		38'773	468'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		22'045	95'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		415'033	727'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		171'540	2'130'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		1'889'167	1'974'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		664'081	1'020'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		833'651	747'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		71'162	109'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.10.2023		10'487	20'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		1'277'967	210'357'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		41'384	47'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.10.2023		95'000	22'829		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.10.2023		20'000	10'993		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		1'020'000	690'193		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		747'000	834'018		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		47'000	42'996		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		1'974'000	1'912'016		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		1'444'000	187'561		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.10.2023		468'000	40'229		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		727'000	429'280		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.10.2023		1'148'000	134'099		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		109'000	73'059		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		210'357'000	1'289'488		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		2'130'000	179'367		SEK/CHF	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		129'085	1'148'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2023		21'103	88'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		10'410	19'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		661'280	980'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		849'317	763'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		41'946	46'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		1'796'119	1'858'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		182'713	1'409'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		41'763	487'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		404'791	687'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		117'798	1'011'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		70'915	106'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		1'296'043	211'094'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		172'456	2'052'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		88'000	19'796		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		687'000	395'870		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		46'000	41'865		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.11.2023		106'000	70'411		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		2'052'000	167'156		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		1'409'000	181'578		DKK/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		211'094'000	1'268'548		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		1'858'000	1'787'396		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		980'000	642'459		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		19'000	10'057		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		763'000	842'627		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		487'000	39'671		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.11.2023		1'011'000	117'579		HKD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		18'402	82'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		389'765	678'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		38'095	42'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		70'269	106'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		164'440	2'023'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		182'532	1'419'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		1'228'480	204'098'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		1'751'942	1'825'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		629'442	963'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		10'024	19'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		827'813	752'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		40'061	493'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		123'292	1'063'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.12.2023		98'000	11'376		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		3'000	2'722		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		93'000	60'809		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		67'000	73'725		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		223'000	18'049		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		114'000	14'628		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		62'000	35'833		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.12.2023		54'000	4'367		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		19'268'000	116'359		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		9'000	5'967		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		166'000	158'934		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		48'000	3'955		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		2'000	1'324		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		20'000	22'029		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		7'000	1'637		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		35'000	4'509		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		46'000	44'179		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		4'634'000	27'636		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		24'000	15'593		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		18'000	10'357		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.12.2023		18'000	2'065		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.12.2023		19'000	10'205		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.12.2023		439'000	35'414		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		1'752'000	145'363		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		598'000	344'765		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		1'613'000	1'530'253		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		1'270'000	161'595		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		39'000	33'911		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		846'000	542'540		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		665'000	731'992		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		95'000	61'896		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.12.2023		947'000	105'433		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		180'196'000	1'059'841		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		75'000	17'511		ILS/CHF	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.01.2024		9'635	18'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		35'321	439'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		150'968	1'823'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		361'716	629'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		1'685'114	1'780'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		168'536	1'327'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		36'388	42'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		589'470	922'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		744'956	679'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		61'765	95'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		105'610	952'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		18'861	81'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		15'085	16'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		6'428	10'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		1'518	12'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		1'749	21'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		3'435	6'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		8'795	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2024		10'000	2'372		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2024		70'000	5'852		NOK/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		158'000	20'008		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		106'000	68'446		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		204'000	17'313		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		72'000	41'949		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		201'000	189'797		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		5'000	4'299		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		9'000	5'826		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		81'000	88'243		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.01.2024		101'000	11'124		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		1'181'000	147'283		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		1'595'000	1'482'792		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		172'388'000	1'029'105		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		606'000	650'177		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		563'000	323'314		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		86'000	54'870		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2024		369'000	30'579		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		826'000	527'203		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2024		71'000	16'595		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.01.2024		851'000	91'721		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		37'000	31'140		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		1'640'000	136'940		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.01.2024		18'000	9'592		NZD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		1'139'191	193'899'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		11'938	2'006'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.01.2024		23'007'000	138'024		JPY/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		153'261	1'231'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		1'542'150	1'662'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		1'038'446	173'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		680'379	636'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		352'404	615'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		56'681	89'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		30'423	368'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		551'889	867'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.02.2024		16'547	71'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		96'006	893'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		32'721	39'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		148'168	1'778'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2024		9'032	17'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.02.2024		409'000	45'548		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		166'000	13'727		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		40'000	25'976		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		31'000	7'192		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		282'000	161'235		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2024		7'000	3'702		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		17'000	14'803		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		760'000	717'115		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		397'000	256'451		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		290'000	319'868		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		79'436'000	466'412		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		813'000	67'428		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		557'000	70'498		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		902'000	840'439		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		40'000	9'433		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		22'000	18'873		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		94'264'000	553'179		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		346'000	377'953		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2024		10'000	5'281		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		965'000	80'134		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		49'000	31'457		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.02.2024		484'000	53'116		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		674'000	84'257		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		333'000	188'838		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		470'000	301'764		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		202'000	16'572		NOK/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		848'021	912'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 04.03.2024		8'939	38'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		17'954	21'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		594'254	101'113'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		377'865	347'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		4'737	9'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		78'225	944'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		30'113	47'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 04.03.2024		47'951	438'000		CHF/HKD	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		87'103	698'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.01.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		188'948	334'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		304'077	475'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		16'038	196'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	215'753.54	1.01
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	13'942'701.21	65.38
Bezugsrechte	101.93	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	7'072'378.65	33.16
Sonstige Vermögenswerte	94'926.18	0.45
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	21'325'861.51	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-68'820.71	
Andere Verbindlichkeiten	-9'379.33	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	21'247'661.47	

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);	21'015'181.78	98.54
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.	0.01	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.56708174
CAD	1 = CHF	0.64207926
DKK	100 = CHF	12.50182200
EUR	1 = CHF	0.93183793
GBP	1 = CHF	1.09242908
HKD	100 = CHF	10.97380800
ILS	1 = CHF	0.23581560
JPY	100 = CHF	0.58686500
NOK	100 = CHF	8.20390900
NZD	1 = CHF	0.52804957
SEK	100 = CHF	8.30256400
SGD	1 = CHF	0.64193512
USD	1 = CHF	0.85785000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	371'668.48	1.749
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	2'608'381.94	12.276

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
NT CHF	CHF	0.00 - 0.18	-	0.117	0.00 - 0.05	-	0.045
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.18	-	0.117	0.00 - 0.05	-	0.045

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2023 - 31.01.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max			Eff	Max
NT CHF	-	-	-	-	-	-
NTH1 CHF	-	-	-	-	-	-

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

8 Benchmark

MSCI World ex USA ex Switzerland Index

9 TER

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

10 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 14.05.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 17.05.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF	Nein	CHF	3.677	1.286	2.391
NTH1 CHF	Nein	CHF	4.140	1.449	2.691

11 Fussnoten

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

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung 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 Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um all-fällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 0.0001 der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen

anfallen;

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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund II**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex US ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small Cap World ex CH

und des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Domestic CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB Foreign CHF
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB 1-5 CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Total Market AAA-BBB CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund USA Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Aggregate Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex JPY/CHF) Inflation-Linked
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. EUR Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. USD Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World ex EUR/USD
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. World Responsible
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Emerging Markets Hard Currency
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Europe (ex CH) indirect
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Asia indirect
Swisscanto (CH) Index Commodity Fund

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, neun Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit einem Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V (nachfolgend auch "der / die Umbrella-Fonds") zu vereinigen und den Fondsvertrag des übertragenden Umbrella-Fonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu den Vereinigungen und zu den in Zusammenhang mit den Vereinigungen erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgenden Vereinigungen durchzuführen:

Übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Stichtag der Vereinigungen (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	22. November 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.		
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.		

2 Gründe für die Vereinigungen

Mit den Vereinigungen soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anleger ist. Die Vereinigungen erlauben das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglichen ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

Die Voraussetzungen für Vereinigungen sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 der Fondsverträge der Umbrella-Fonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist bei den übertragenden Teilvermögen sowie beim übernehmenden Teilvermögen in § 25 des jeweiligen Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Am gleichen Tag werden die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen werden mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum die übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V vereinigt. Die Vereinigungen erfolgen durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen werden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anleger und Anlegerinnen der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V. Die Anteilsklassen der übertragenden Teilvermögen entsprechen dabei jeweils inhaltlich den Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigungen überführt werden.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragendes Teilvermögen)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen)
NT EUR	NT EUR
ST EUR	NT EUR

Am 23. November 2023 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V bzw. übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II aufgrund der Schlusskurse vom 22. November 2023 durchgeführt. Am 23. November 2023 (Bewertungstag), erfolgen die Vereinigungen durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der übertragenden Teilvermögen auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf 22. November 2023 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 8. August 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplanten Vereinigungen erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigungen

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigungen überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigungen durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigungen mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie den Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen auf www.fundinfo.com veröffentlichen.

7 Kosten

Den übertragenden (und dem übernehmenden) Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen wird die Ausgabe bzw. Rückzahlung von Anteilen der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und des übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigungen führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigungen lösen auf Ebene der an den Vereinigungen beteiligten Teilvermögen weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

Im Hinblick auf die Vereinigungen muss der Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II angepasst werden.

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 25 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II sowie des übernehmenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen der übertragenden Teilvermögen für die Vereinigungen mit dem übernehmenden Teilvermögen in Einklang mit den betreffenden Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2, 2.3 und 2.4 nachstehend).
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend).
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4 nachstehend).
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend).
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend).

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigungen und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens, bedarf es einer Anpassung der Bestimmungen der Anlagepolitik des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II.

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen lautet neu wie folgt:

"Anlagen in OTC-Derivate (OTC-Geschäften) sind nur zulässig, wenn (i) die Gegenpartei ein beaufsichtigter, auf dieses Geschäft spezialisierter Finanzintermediär ist, und (ii) die OTC-Derivate täglich handelbar sind oder eine Rückgabe an den Emittenten jederzeit möglich ist. Zudem sind sie zuverlässig und nachvollziehbar bewertbar. Derivate können gemäss § 12 eingesetzt werden.

Anteile bzw. Aktien an anderen kollektiven Kapitalanlagen (Zielfonds). Als "andere kollektive Kapitalanlagen" im Sinne dieses Fondsvertrages gelten:

- *inländische kollektive Kapitalanlagen der Art "Effektenfonds", "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"), wenn deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen.*
- *ausländische offene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und bei denen die Auszahlung von Rücknahme-*

oder Rückkaufsbefugnissen keinen Beschränkungen unterliegt. Es handelt sich um kollektive Kapitalanlagen, (i) deren Dokumente die Anlage in andere Zielfonds ihrerseits auf insgesamt 30% begrenzen; (ii) für welche in Bezug auf Zweck, Organisation, Anlagepolitik, Anlegerschutz, Risikoverteilung, getrennte Verwahrung des Fondsvermögens, Kreditaufnahme, Kreditgewährung, Leerverkäufe von Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten, Ausgabe und Rücknahme der Anteile bzw. Aktien und Inhalt der Halbjahres- und Jahresberichte gleichwertige Bestimmungen gelten wie für Effektenfonds oder Fonds der Art „Übrige Fonds für traditionelle Anlagen“ und (iii) welche im Sitzstaat als kollektive Kapitalanlagen zugelassen sind und dort einer dem Anlegerschutz dienenden, der schweizerischen gleichwertigen Aufsicht unterstehen, und die internationale Amtshilfe gewährleistet ist.

- ausländische geschlossene kollektive Kapitalanlagen, die nach dem Recht irgendeines Staates errichtet sind, die im Zusammenhang mit der Vertriebstätigkeit in der Schweiz bewilligt sein können oder nicht und deren Dokumente die Anlagen in andere Zielfonds ihrerseits insgesamt auf 30% begrenzen. Solche geschlossene kollektive Kapitalanlagen unterliegen in ihrem Heimatstaat überwiegend keiner Aufsicht. Soweit solche kollektive Kapitalanlagen in ihrem Heimatstaat einer Aufsicht unterliegen, wird diese nicht notwendigerweise nach der Praxis der Schweizer Aufsichtsbehörde als "gleichwertig" eingestuft. Zudem wird die internationale Amtshilfe nicht zwingend gewährleistet. Die Anlagepolitik der geschlossenen kollektiven Kapitalanlagen muss derjenigen eines Effektenfonds oder eines übrigen Fonds für traditionelle Anlagen gleichwertig sein (unter Ausschluss der "Übrigen Fonds für alternative Anlagen"). Ihre Anteile bzw. Aktien müssen an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.
- Beteiligungen an Immobilienfonds (einschliesslich Real Estate Investment Trusts, REITs), die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden.

Die Rücknahmefrequenz oder Liquidität der Zielfonds hat grundsätzlich derjenigen des betreffenden Teilvermögens zu entsprechen. Die Verwendung von Zielfonds darf nicht zu einer Veränderung des Anlagecharakters eines Teilvermögens führen. Nach ihrer Rechtsform kann es sich bei den Zielfonds um vertragsrechtliche Anlagefonds, kollektive Kapitalanlagen in gesellschaftsrechtlicher Form, liechtensteinische Treuunternehmen, Business Trusts nach dem Recht US-amerikanischer Gliedstaaten, Investmentvereine oder um Unit Trusts handeln.

Die Fondsleitung kann Anteile bzw. Aktien von offenen kollektiven Kapitalanlagen sowohl aus Ausgabe wie auf dem Sekundärmarkt erwerben und Anteile bzw. Aktien sowohl zurückgeben wie auf dem Sekundärmarkt veräussern.

Die Fondsleitung darf unter Vorbehalt von § 20 Ziff. 6 Anteile bzw. Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen (Zielfonds) erwerben, die unmittelbar oder mittelbar von ihr selbst oder von einer Gesellschaft verwaltet werden, mit der sie durch gemeinsame Verwaltung oder Beherrschung oder durch eine wesentliche direkte oder indirekte Beteiligung verbunden ist. "

Die teilvermögensspezifische Anlagepolitik in § 8 Ziff. 4 bis 12 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird wie folgt angepasst:

"Das Teilvermögen bildet grundsätzlich den Referenzindex FTSE EMU Government Bond Index nach. Dabei kann die Fondsleitung, statt in sämtliche Titel des Referenzindexes zu investieren, auf eine repräsentative Auswahl von Titeln zurückgreifen (Optimized Sampling).

Das Teilvermögen

- a) investiert in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte von privaten, gemischtwirtschaftlichen und öffentlich-rechtlichen Schuldnern, welche Bestandteil des Referenzindexes sind;
- b) darf vorübergehend in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte investieren, die nicht im Referenzindex enthalten sind, von denen jedoch aufgrund der für den Referenzindex vorgesehenen Aufnahmekriterien mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist, dass sie in den Referenzindex aufgenommen werden;
- c) darf in auf Euro lautende Obligationen und andere fest oder variabel verzinsliche Forderungswertpapiere und Forderungswertrechte investieren, die aufgrund des Kriteriums Mindestrestlaufzeit aus dem Referenzindex gestrichen wurden;

- d) investiert in Derivate auf den Referenzindex oder Teilsegmente des Referenzindex und die oben erwähnten Anlagen sowie Indices, die dem Referenzindex bzw. Teilsegmenten des Referenzindex nahestehen und die eine hohe Korrelation zum Referenzindex bzw. zum entsprechenden Teilsegment des Referenzindex aufweisen;
- e) weist eine Modified Duration auf, die um nicht mehr als 0.5 von der Modified Duration des Referenzindex abweicht.
- f) investiert in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen, die auf den Referenzindex oder Teilsegmente des Referenzindex lauten sowie auf Indices lauten, die dem Referenzindex bzw. Teilsegmenten des Referenzindex nahestehen und die eine hohe Korrelation zum Referenzindex bzw. zum entsprechenden Teilsegment des Referenzindex aufweisen;

Mit Ausnahme der Anlagen gemäss lit. c oben müssen Anlagen (einschliesslich Derivate auf diesen Anlagen), die aus dem Referenzindex gestrichen werden, unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist veräussert werden.

Die Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss lit. f oben dürfen 30% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten."

2.2 Flüssige Mittel

In den Vorschriften über flüssige Mittel (vgl. § 9 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen) wird präzisiert, dass die Fondsleitung für jedes Teilvermögen zusätzlich angemessene flüssige Mittel in der weiteren Zeichnungs-/Rücknahmewährung der Anteilsklassen halten darf.

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

Die zu beurteilenden Vorschriften innerhalb der Effektenleihe der zu vereinigenden Teilvermögen werden dahingehend angepasst, dass die Fondsleitung für Rechnung der Teilvermögen Effektenleihe-Geschäfte tätigen darf (vgl. § 10 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen). In der Folge lauten die neuen Bestimmungen:

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen sämtliche Arten von Effekten ausleihen, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen worden sind, dürfen hingegen nicht ausgeliehen werden.
2. Die Fondsleitung kann die Effekten im eigenen Namen und auf eigene Rechnung einem Borger ausleihen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, die Effekten entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") einem Borger zur Verfügung zu stellen.
3. Die Fondsleitung tätigt die Effektenleihe nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Borgern und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahrern, die eine einwandfreie Durchführung der Effektenleihe gewährleisten.
4. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerkstage nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die ausgeliehenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom ausleihfähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% ausleihen. Sichert hingegen der Borger oder der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerktag wieder rechtlich über die ausgeliehenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte ausleihfähige Bestand einer Art ausgeliehen werden.
5. Die Fondsleitung vereinbart mit dem Borger oder Vermittler, dass dieser zwecks Sicherstellung des Rückerstattungsanspruches zugunsten der Fondsleitung Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA verpfändet oder zu Eigentum überträgt. Der Wert der Sicherheiten muss angemessen sein und jederzeit mindestens 100% des Verkehrswerts der ausgeliehenen Effekten betragen. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art.

52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.

6. Der Borger oder Vermittler haftet für die pünktliche und uneingeschränkte Vergütung der während der Effektenleihe anfallenden Erträge, die Geltendmachung anderer Vermögensrechte sowie die vertragskonforme Rückerstattung von Effekten gleicher Art, Menge und Güte.
7. Die Depotbank sorgt für eine sichere und vertragskonforme Abwicklung der Effektenleihe und überwacht namentlich die Einhaltung der Anforderungen an die Sicherheiten. Sie besorgt auch während der Dauer der Leihgeschäfte die ihr gemäss Depotreglement obliegenden Verwaltungshandlungen und die Geltendmachung sämtlicher Rechte auf den ausgeliehenen Effekten, soweit diese nicht gemäss anwendbarem Rahmenvertrag abgetreten wurden.
8. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens darf die Fondsleitung auf Rechnung der Teilvermögen Pensionsgeschäfte abschliessen (vgl. § 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen). Die neuen Bestimmungen lauten wie folgt:

- "1. Die Fondsleitung darf für Rechnung der Teilvermögen Pensionsgeschäfte abschliessen. Pensionsgeschäfte können entweder als "Repo" oder als "Reverse Repo" getätigt werden.

Das Repo ist ein Rechtsgeschäft, durch das eine Partei (Pensionsgeber) das Eigentum an Effekten gegen Bezahlung vorübergehend auf eine andere Partei (Pensionsnehmer) überträgt, und bei dem der Pensionsnehmer sich verpflichtet, dem Pensionsgeber bei Fälligkeit Effekten gleicher Art, Menge und Güte sowie die während der Dauer des Pensionsgeschäftes anfallenden Erträge zurückzuerstatten. Der Pensionsgeber trägt das Kursrisiko der Effekten während der Dauer des Pensionsgeschäftes.

Das Repo ist aus der Sicht der Gegenpartei (Pensionsnehmer) ein Reverse Repo. Mit einem Reverse Repo erwirbt die Fondsleitung zwecks Geldanlage Effekten und vereinbart gleichzeitig, Effekten gleicher Art, Menge und Güte sowie die während der Dauer des Pensionsgeschäftes anfallenden Erträge zurückzuerstatten.

2. Die Fondsleitung kann Pensionsgeschäfte im eigenen Namen und auf eigene Rechnung mit einer Gegenpartei abschliessen ("Principal-Geschäft") oder einen Vermittler damit beauftragen, entweder treuhänderisch in indirekter Stellvertretung ("Agent-Geschäft") oder in direkter Stellvertretung ("Finder-Geschäft") Pensionsgeschäfte mit einer Gegenpartei zu tätigen.
3. Die Fondsleitung tätigt Pensionsgeschäfte nur mit auf diese Geschäftsart spezialisierten, erstklassigen beaufsichtigten Gegenparteien und Vermittlern wie Banken, Brokern und Versicherungsgesellschaften sowie mit bewilligten und anerkannten zentralen Gegenparteien und Zentralverwahren, die eine einwandfreie Durchführung des Pensionsgeschäftes gewährleisten.
4. Die Depotbank sorgt für eine sichere und vertragskonforme Abwicklung des Pensionsgeschäftes. Sie sorgt dafür, dass die Wertveränderungen der im Pensionsgeschäft verwendeten Effekten täglich in Geld oder Effekten ausgeglichen werden (mark to market) und besorgt auch während der Dauer des Pensionsgeschäftes die ihr gemäss Depotreglement obliegenden Verwaltungshandlungen und die Geltendmachung sämtlicher Rechte auf den im Pensionsgeschäft verwendeten Effekten, soweit diese nicht gemäss anwendbarem Rahmenvertrag abgetreten wurden.

5. Die Fondsleitung darf für Repos sämtliche Arten von Effekten verwenden, die an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden. Effekten, welche im Rahmen von Reverse Repos übernommen wurden, dürfen nicht für Repos verwendet werden.
6. Sofern die Fondsleitung eine Kündigungsfrist, deren Dauer sieben Bankwerkzeuge nicht überschreiten darf, einhalten muss, bevor sie wieder über die in Pension gegebenen Effekten rechtlich verfügen kann, darf sie je Teilvermögen vom repofähigen Bestand einer Art nicht mehr als 50% für Repos verwenden. Sichert hingegen die Gegenpartei bzw. der Vermittler der Fondsleitung vertraglich zu, dass diese noch am gleichen oder am nächsten Bankwerkzeug wieder rechtlich über die in Pension gegebenen Effekten verfügen kann, so darf der gesamte repofähige Bestand einer Art für Repos verwendet werden.
7. Repos gelten als Kreditaufnahme gemäss § 13, es sei denn, die erhaltenen Mittel werden für die Übernahme von Effekten gleicher Art, Güte, Bonität und Laufzeit in Verbindung mit dem Abschluss eines Reverse Repo verwendet.
8. Die Fondsleitung darf im Rahmen eines Reverse Repo nur Sicherheiten nach Massgabe von Art. 51 KKV-FINMA erwerben. Der Emittent der Sicherheiten muss eine hohe Bonität aufweisen und die Sicherheiten dürfen nicht von der Gegenpartei oder von einer dem Konzern der Gegenpartei angehörigen oder davon abhängigen Gesellschaft begeben sein. Die Sicherheiten müssen hoch liquide sein, zu einem transparenten Preis an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden und mindestens börsentäglich bewertet werden. Die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte müssen bei der Verwaltung der Sicherheiten die Pflichten und Anforderungen gemäss Art. 52 KKV-FINMA erfüllen. Insbesondere müssen sie die Sicherheiten in Bezug auf Länder, Märkte und Emittenten angemessen diversifizieren, wobei eine angemessene Diversifikation der Emittenten als erreicht gilt, wenn die von einem einzelnen Emittenten gehaltenen Sicherheiten nicht mehr als 20% des Nettoinventarwerts entsprechen. Vorbehalten bleiben Ausnahmen für öffentlich garantierte oder begebene Anlagen gemäss Art. 83 KKV. Weiter muss die Fondsleitung bzw. deren Beauftragte die Verfügungsmacht und die Verfügungsbefugnis an den erhaltenen Sicherheiten bei Ausfall der Gegenpartei jederzeit und ohne Einbezug der Gegenpartei oder deren Zustimmung erlangen können. Die erhaltenen Sicherheiten sind bei der Depotbank zu verwahren. Die erhaltenen Sicherheiten können im Auftrag der Fondsleitung bei einer beaufsichtigten Drittverwahrstelle verwahrt werden, wenn das Eigentum an den Sicherheiten nicht übertragen wird und die Drittverwahrstelle von der Gegenpartei unabhängig ist.
9. Forderungen aus Reverse Repo gelten als flüssige Mittel gemäss § 9 und nicht als Kreditgewährung gemäss § 13.
10. Der Prospekt enthält weitere Angaben zur Sicherheitenstrategie."

Sodann wird, in Angleichung an die Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens, in § 12 Ziff. 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen betreffend weitere Angaben zu bestimmten Themen im Prospekt die bestehende Aufzählung angepasst. Angaben zu der allfällig aus der Verwendung von Derivaten resultierenden erhöhten Volatilität sowie Angaben zum allfälligen Einsatz von Kreditderivaten sind nicht mehr im Prospekt enthalten.

2.4 Risikoverteilung und Risiken

Die Fondsleitung hat neu die Limite von 10% (bisher 20%) bei Anlagen von Vermögen eines Teilvermögens in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten einschliesslich Derivate zu berücksichtigen. Diese Grenze von 10% ist auf 20% angehoben, wenn der Emittent (oder ein allfälliger Garant) ein Rating von mindestens A- (S&P oder ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) aufweist oder wenn die Fondsleitung den Emittenten bzw. Garanten bei Fehlen eines Agenturratings gestützt auf ein internes Rating der Depotbank als von gleicher Qualität einstuft. Der Gesamtwert der Effekten und Geldmarktinstrumente der Emittenten, bei welchen mehr als 5% (bisher 10%) des Vermögens eines Teilvermögens angelegt sind, darf 40% (bisher 60%) des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens nicht übersteigen (vgl. § 15 Ziff. 3, 4, 13 und 14 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

Zudem wird in § 13 Ziff. 5 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen präzisiert, dass sofern das Rating A-1 oder gleichwertig erreicht, die Beschränkung für Anlagen in Guthaben auf Sicht und auf Zeit bei derselben Bank 30% statt 20% des Vermögens eines Teilvermögens beträgt.

Anlagen, Guthaben und Forderungen gemäss § 13 Ziff. 3 bis 9 desselben Emittenten bzw. Schuldners dürfen insgesamt 30% des Vermögens eines Teilvermögens nicht übersteigen (bisher 20%) (vgl. § 15 Ziff. 7 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

Die Bestimmung, wonach die Fondsleitung keine Beteiligungsrechte erwerben darf, die insgesamt mehr als 10% der Stimmrechte ausmachen oder die es ihr erlauben, einen wesentlichen Einfluss auf die Geschäftsleitung eines Emittenten auszuüben, wird neu in § 13 Ziff. 11 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen aufgeführt.

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens werden weitere Ergänzungen vorgenommen. Die in Ziff. 3 von § 13 erwähnte Grenze ist von 10% auf 20% angehoben, wenn es sich um Pfandbriefe schweizerischer Pfandbriefinstitute mit erstklassigem Rating (AAA Rating von Standard & Poor's bzw. ein gleichwertiges Rating einer anderen Ratingagentur) handelt. Pfandbriefe bleiben bei der Anwendung der Grenze von 40% nach Ziff. 3 ausser Betracht. Zudem wird neu festgehalten, dass wenn für die Verpflichtungen ein Emittent bzw. eine Gegenpartei wie ein Garant einsteht, kann bei der Beurteilung des Gesamtengagements bei besserem Rating auch auf den Garant abgestellt werden. Sollte das Rating einer Gegenpartei oder eines Garanten unter das geforderte Mindestrating sinken, so sind die noch offenen Positionen unter Wahrung der Interessen der Anleger innerhalb einer angemessenen Frist glattzustellen (vgl. § 13 Ziff. 15, 17 und 18 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen).

3 Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten

In § 23 Ziff. 1 Bst. c des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird die Bestimmung ersatzlos gestrichen, wonach in jedem Fall mindestens 70% des jährlichen Nettoertrags inklusive der vorgetragenen Erträge früherer Rechnungsjahre ausgeschüttet werden.

4 Art, Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen

In § 20 Ziff. 5 des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen wird neu ausgeführt, dass die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen höchstens 3% p.a. betragen darf. Im Jahresbericht ist der maximale Satz der Verwaltungskommission der Zielfonds, in die investiert wird, unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen für diese Teilvermögen anzugeben.

5 Rücknahmebedingungen

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Teilvermögens wird in § 17 Ziff. 1 die Definition des Bankwerktages präzisiert. Als Bankwerktag gilt jeder Tag, an welchem die Banken in der Stadt Zürich geöffnet sind. Keine Ausgaben oder Rücknahmen finden an schweizerischen und stadtzürcherischen Feiertagen statt sowie an Tagen, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des entsprechenden Teilvermögens geschlossen sind (vgl. § 16 Ziff. 1) oder wenn ausserordentliche Verhältnisse im Sinne von § 17 Ziff. 5 vorliegen.

Darüber hinaus wird ergänzt, dass die Ausgabe- und Rücknahmepreise auf jeweils vier Stellen nach dem Komma gerundet werden; vorbehalten bleiben Sonderfälle.

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

Die Laufzeit des Fondsvertrages der übertragenden Teilvermögen und des übernehmenden Teilvermögens sowie die Voraussetzungen der Auflösung bei den zu vereinigenden Teilvermögen stimmen grundsätzlich überein.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in Teil II Ziff. 2 und 5 der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge 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 Teilvermögens bzw. des Teilvermögens in bar verlangen können bzw. den Antrag auf Sachauslage stellen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund II**

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

betreffend die Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.
(nachfolgend "übertragende Teilvermögen")

und des **Swisscanto (CH) Index Fund V**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

betreffend das Teilvermögen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.
(nachfolgend "übernehmendes Teilvermögen")

hinsichtlich

Vereinigungen vom 22. November 2023

Zur Bekanntgabe:

1. des Vollzuges der Vereinigungen;
2. der Umtauschverhältnisse; und
3. der Bestätigung der Prüfgesellschaft.

1 Vollzug der Vereinigungen

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben die übertragenden Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 22. November 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 18. September 2023 in den Publikationsorganen der von den Vereinigungen betroffenen Teilvermögen über die geplanten Vereinigungen und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigungen wurden die übertragenden Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 22. November 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögen auch für die übertragenden Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnis

Die Fondsleitung ermittelte das Umtauschverhältnis, welches von der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft Ernst & Young AG geprüft und für korrekt befunden wurde.

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger der übertragenden Teilvermögen erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigungen basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 22. November 2023:

Übertragende Teilvermögen			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.	NT EUR	CH0215803948	EUR 92.68
	ST EUR	CH0302432049	EUR 84'132.27
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.	NT EUR	CH0215803989	EUR 96.07
	ST EUR	CH0302432064	EUR 85'512.87
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.	NT EUR	CH0215804037	EUR 92.78
	ST EUR	CH0302432072	EUR 85'501.30
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.	NT EUR	CH0215804086	EUR 96.31
	ST EUR	CH0302432098	EUR 87'100.07
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	NT EUR	CH0215804110	EUR 94.48
	ST EUR	CH0302432130	EUR 86'717.01
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.	NT EUR	CH0215804128	EUR 99.91
	ST EUR	CH0302432148	EUR 87'805.08
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.	NT EUR	CH0215804268	EUR 110.75
	ST EUR	CH0302432163	EUR 93'922.69
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	NT EUR	CH0215804300	EUR 92.82
	ST EUR	CH0302432171	EUR 84'390.42
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	NT EUR	CH0215804342	EUR 108.42
	ST EUR	CH0302432254	EUR 93'153.61

Übernehmendes Teilvermögen			
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.	NT EUR	CH0117045150	EUR 113.84

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergeben sich folgende Umtauschverhältnisse aus Sicht des jeweiligen übertragenden Teilvermögen (1 Anteil des übertragenden Teilvermögen ↔ Anzahl Anteile des übernehmenden Teilvermögen):

Übertragende Teilvermögen		
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis ¹
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.	NT EUR	1 zu 0.8141069428
	ST EUR	1 zu 739.0454261124
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.	NT EUR	1 zu 0.8438950298
	ST EUR	1 zu 751.1730216961
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.	NT EUR	1 zu 0.8149953411
	ST EUR	1 zu 751.0714046741
Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.	NT EUR	1 zu 0.8459861506
	ST EUR	1 zu 765.1154933048
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.	NT EUR	1 zu 0.8299593985
	ST EUR	1 zu 761.7506315166
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.	NT EUR	1 zu 0.8776731516
	ST EUR	1 zu 771.3085595374
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.	NT EUR	1 zu 0.9728371650

Übertragende Teilvermögen	Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II	ST EUR	1 zu 825.0476743532
	NT EUR	1 zu 0.8153282314
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.	ST EUR	1 zu 741.3130290303
	NT EUR	1 zu 0.9524302585
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.	ST EUR	1 zu 818.2917647532

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 30. November 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigungen wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung der Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt., Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt. (übertragende Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund II») mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. (übernehmendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds «Swisscanto (CH) Index Fund V») per 22. November 2023 geprüft.

Für die Berechnung der Umtauschverhältnisse ist die Fondsleitung verantwortlich, während unsere Aufgabe darin besteht, die Berechnung der Umtauschverhältnisse zu prüfen und zu beurteilen.

Unsere Prüfung erfolgte nach den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH), wonach eine Prüfung so zu planen und durchzuführen ist, dass wesentliche Fehlaussagen in der Berechnung der Umtauschverhältnisse mit angemessener Sicherheit erkannt werden. Wir prüften die Grundlagen der Berechnung der Umtauschverhältnisse mittels Analysen und Erhebungen auf der Basis von Stichproben. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine ausreichende Grundlage für unser Urteil bildet.

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigungen gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt.

Ernst & Young AG
Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber"

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag der Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und Swisscanto (CH) Index Fund V, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 21. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich