

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND USA

Jahresbericht per 29.02.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FA USD	31562300	USD
GT USD	38329213	USD
NT CHF	38327784	CHF
NT USD	11704469	USD
NTH1 CHF	42356156	CHF

Rechnungswährung: USD

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Juni 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund V,

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) Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible¹
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible¹
- ▶ 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 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

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 29. Februar 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr¹, 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.

¹ Erfolgsrechnungen für den Zeitraum vom 31. Oktober 2022 bis 29. Februar 2024 für die Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe (ex CH) Responsible, Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible und Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible.

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 Unvollständigkeiten, 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 29. Februar 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	20
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	21
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	21
7	Pauschale Verwaltungskommission	22
8	Benchmark	22
9	TER	22
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	23
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	23
12	Fussnoten	23
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	24
14	Pflichtpublikationen	26

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	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021	01.03.2020
	bis	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022	28.02.2021
Konsolidiert					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		736'810'198.86	574'009'510.16	732'333'360.20	944'454'122.94
Klasse FA USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		91'352'113.03	77'539'270.42	88'723'521.60	77'831'491.94
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		365'211.575	399'064.993	411'992.454	407'515.207
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		250.1348	194.3024	215.3523	190.9904
Ausschüttung je Anteil		2.05	2.05	1.60	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
Klasse GT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		172'844'276.05	78'116'244.47	97'212'043.52	265'215'012.58
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		845'003.462	494'972.459	558'932.607	1'728'359.280
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		204.5486	157.8194	173.9244	153.4490
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		180.1153	147.9162	159.5670	138.9174
Thesaurierung je Anteil		1.77	1.59	1.45	1.35
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		49'217'932.51	39'852'203.23	119'500'116.70	105'591'525.58
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		222'582.843	233'814.840	636'714.425	638'337.155
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		194.7089	159.7481	172.1893	149.7516
Thesaurierung je Anteil (in USD)		2.18	1.96	1.83	1.66
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		407'410'451.85	360'477'212.69	404'990'802.51	480'581'143.93
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		908'673.589	1'043'049.094	1'064'213.382	1'432'831.024
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		448.3573	345.5995	380.5541	335.4067
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		394.8010	323.9131	349.1394	303.6437
Thesaurierung je Anteil		4.42	3.98	3.72	3.36
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in USD)		15'985'425.42	18'024'579.35	21'906'875.87	15'234'948.91
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		88'393.291	130'947.249	136'195.294	104'536.022
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		159.2425	129.0102	147.5709	131.9373
Thesaurierung je Anteil (in USD)		1.81	1.58	1.58	1.44
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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 FA USD	29.98 %	26.31 %	-19.93 %	26.17 %
Klasse GT USD	30.03 %	26.36 %	-19.90 %	26.23 %
Klasse NT CHF	22.33 %	15.11 %	-18.55 %	30.29 %
Klasse NT USD	30.21 %	26.53 %	-19.79 %	26.40 %
Klasse NTH1 CHF	23.87 %	20.20 %	-22.44 %	24.72 %
Benchmark Hedge	23.76 %	20.13 %	-	-
Benchmark	30.11 %	26.49 %	-19.85 %	26.45 %
Tracking Error 33)	0.09 %	0.07 %	0.11 %	0.04 %

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

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse FA USD	-0.13 %
Klasse GT USD	-0.08 %
Klasse NT CHF	-7.78 %
Klasse NT USD	0.10 %
Klasse NTH1 CHF	0.11 %

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)	29.02.2024	28.02.2023
Bankguthaben auf Sicht	5'754'568.39	7'847'483.19
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	730'284'321.10	565'557'036.51
Sonstige Vermögenswerte	804'039.10	624'855.62
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	736'842'928.59	574'029'375.32
Andere Verbindlichkeiten	-32'729.73	-19'865.16
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	736'810'198.86	574'009'510.16

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse FA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		399'064.993	411'992.454
Ausgegebene Anteile		61'343.586	34'472.269
Zurückgenommene Anteile		-95'197.004	-47'399.730
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		365'211.575	399'064.993
Klasse GT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		494'972.459	558'932.607
Ausgegebene Anteile		529'370.154	72'294.000
Zurückgenommene Anteile		-179'339.151	-136'254.148
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		845'003.462	494'972.459
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		233'814.840	636'714.425
Ausgegebene Anteile		-	40'522.000
Zurückgenommene Anteile		-11'231.997	-443'421.585
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		222'582.843	233'814.840
Klasse NT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'043'049.094	1'064'213.382
Ausgegebene Anteile		157'396.326	308'896.351
Zurückgenommene Anteile		-291'771.831	-330'060.639
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		908'673.589	1'043'049.094
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		130'947.249	136'195.294
Ausgegebene Anteile		2'917.779	8'546.471
Zurückgenommene Anteile		-45'471.737	-13'794.516
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		88'393.291	130'947.249

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		574'009'510.16	732'333'360.20
Ausbezahlte Ausschüttung		-776'213.54	-648'740.15
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-2'007'725.95	-2'176'973.17
Saldo aus dem Anteilverkehr		-15'117'533.69	-85'286'047.79
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		180'702'161.88	-70'212'088.93
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		736'810'198.86	574'009'510.16

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		298'972.25	47'424.58
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-577.91
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		7'279'544.74	7'095'500.56
Erträge der Gratisaktien		2'988.68	6'176.87
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		546'807.23	820'783.52
Total Ertrag		8'128'312.90	7'969'307.62
Aufwand			
Passivzinsen		-8.44	0.00
Reglementarische Vergütungen		-362'685.36	-262'216.09
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-838'304.12	-1'345'944.56
Total Aufwand		-1'200'997.92	-1'608'160.65
Nettoertrag / Verlust		6'927'314.98	6'361'146.97
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		26'950'824.68	30'762'424.37
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		219'487.42	277'016.67
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		79'706.52	86'232.16
Realisierter Erfolg		34'177'333.60	37'486'820.17
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		146'524'828.28	-107'698'909.10
Gesamterfolg		180'702'161.88	-70'212'088.93

Verwendung des Erfolges

Klasse FA USD	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	761'312.22	751'936.33
Vortrag des Vorjahres	5'037.94	71'184.85
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	766'350.16	823'121.18
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	748'683.73	818'083.24
Vortrag auf neue Rechnung	17'666.43	5'037.94
Total	766'350.16	823'121.18

Klasse GT USD	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	1'498'032.97	789'980.12
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'498'032.97	789'980.12
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	524'311.54	276'493.04
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	973'721.43	513'487.08
Total	1'498'032.97	789'980.12

Klasse NT CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	485'830.93	459'025.63
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	485'830.93	459'025.63
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	170'040.83	160'658.97
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	315'790.10	298'366.66
Total	485'830.93	459'025.63

Klasse NT USD	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	4'021'554.81	4'152'049.10
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	4'021'554.81	4'152'049.10
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	1'407'544.18	1'453'217.19
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	2'614'010.63	2'698'831.92
Vortrag auf neue Rechnung	0.00	-0.01
Total	4'021'554.81	4'152'049.10

Klasse NTH1 CHF	29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag	160'584.05	208'155.79
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	160'584.05	208'155.79
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	56'204.42	72'854.53
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	104'379.63	135'301.26
Total	160'584.05	208'155.79

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							730'284'321.10	99.11	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							730'284'321.10	99.11	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	738	103	101	740 USD	1'595.30	1'180'522.00	0.16	a)
AR							1'180'522.00	0.16	
US0494681010	ATLISSIAN CORP-CL A	2'398	0	0	2'398 USD	207.42	497'393.16	0.07	a)
AU							497'393.16	0.07	
BMG0450A1053	ARCH CAPITAL GROUP LTD	5'424	1'899	1'774	5'549 USD	87.59	486'036.91	0.07	a)
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	567	913	715	765 USD	368.88	282'193.20	0.04	a)
BMG611881274	LIBERTY GLOBAL LTD-C	0	2'682	0	2'682 USD	18.55	49'751.10	0.01	a)
BM							817'981.21	0.11	
US5500211090	LULULEMON ATHLETICA INC	2'055	227	341	1'941 USD	467.09	906'621.69	0.12	a)
CA							906'621.69	0.12	
CH0044328745	CHUBB LTD	6'732	908	658	6'982 USD	251.67	1'757'159.94	0.24	a)
CH0102993182	TE CONNECTIVITY LTD	4'698	1'004	1'008	4'694 USD	143.56	673'870.64	0.09	a)
CH0114405324	GARMIN LTD	2'683	0	0	2'683 USD	137.35	368'510.05	0.05	a)
CH							2'799'540.63	0.38	
GB00B8W67662	LIBERTY GLOBAL PLC-A	399	0	399	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00B8W67B19	LIBERTY GLOBAL PLC- C	2'682	0	2'682	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00DB6Q211	WILLIS TOWERS WATSON PLC	1'700	549	541	1'708 USD	272.61	465'617.88	0.06	a)
IE00BLP1HW54	AON PLC-CLASS A	3'573	0	228	3'345 USD	315.99	1'056'986.55	0.14	a)
IE00BS09M33	PENTAIR PLC	2'868	0	0	2'868 USD	77.79	223'101.72	0.03	a)
IE00BZ12WP82	LINDE PLC	7'934	0	7'934	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00B783TY65	APTIV PLC	4'644	0	0	4'644 USD	79.49	369'151.56	0.05	a)
JE00BJ1F3079	AMCOR PLC	24'472	0	0	24'472 USD	9.06	221'716.32	0.03	a)
JE00BJN4441	CLARIVATE PLC	7'322	0	7'322	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	3'300	0	0	3'300 GBP	16'716.08	697'785.00	0.09	a)
LIN GRXXX	LINDE PLC	0	8'816	8'816	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	0	16'829	0	16'829 EUR	11.04	201'106.56	0.03	a)
GB							3'235'465.59	0.44	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	9'913	1'482	1'320	10'075 USD	374.78	3'775'908.50	0.51	a)
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	850	0	0	850 USD	118.90	101'065.00	0.01	a)
IE00BFR3W74	ALLEGION PLC	800	1'214	1'180	834 USD	127.87	106'643.58	0.01	a)
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	3'653	693	780	3'566 USD	281.97	1'005'505.02	0.14	a)
IE00BKVD2N49	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3'469	0	0	3'469 USD	93.05	322'790.45	0.04	a)
IE00BQPQZ61	HORIZON THERAPEUTICS PLC	3'945	0	3'945	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	21'577	2'365	1'991	21'951 USD	83.36	1'829'835.36	0.25	a)
IE							7'141'747.91	0.97	
US83417M1045	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	1'024	0	1'024	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IL							0.00	0.00	
JE00BYSS4X48	NOVOCURE LTD	2'070	0	2'070	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE							0.00	0.00	
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	3'913	1'189	683	4'419 USD	249.73	1'103'556.87	0.15	a)
NL							1'103'556.87	0.15	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	22'956	4'241	5'764	21'433 USD	48.33	1'035'856.89	0.14	a)
BMG169621056	BUNGE LTD	2'646	0	2'646	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BMG491BT1088	INVESCO LTD	2'017	7'817	9'834	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA94106B1013	WASTE CONNECTIONS INC	4'124	0	0	4'124 USD	166.44	686'398.56	0.09	a)
CH1300646267	BUNGE GLOBAL SA	0	2'646	0	2'646 USD	94.37	249'703.02	0.03	a)
GB00BFMBMT84	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2'107	0	2'107	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	4'682	3'604	3'350	4'936 USD	30.34	149'758.24	0.02	a)
IE00S9YS762	LINDE PLC	0	8'474	715	7'759 USD	448.82	3'482'394.38	0.47	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	6'223	1'282	1'157	6'348 USD	289.00	1'834'572.00	0.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
IE00BFY8C754	STERIS PLC	1'239	1'057	610	1'686 USD	232.91	392'686.26	0.05	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	10'238	3'635	1'892	11'981 USD	59.27	710'113.87	0.10	a)
LR0008862868	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3'831	0	0	3'831 USD	123.35	472'553.85	0.06	a)
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	4'762	0	781	3'981 USD	100.28	399'214.68	0.05	a)
PA1436583006	CARNIVAL CORP	15'313	0	0	15'313 USD	15.86	242'864.18	0.03	a)
US0010551028	AFLAC INC	9'849	2'008	1'910	9'947 USD	80.74	803'120.78	0.11	a)
US00130H1059	AES CORP	10'184	0	0	10'184 USD	15.20	154'796.80	0.02	a)
US00206R1023	AT&T INC	115'711	13'520	15'949	113'282 USD	16.93	1'917'864.26	0.26	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	27'626	4'303	3'087	28'842 USD	118.64	3'421'814.88	0.46	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	28'632	3'920	3'954	28'598 USD	176.05	5'034'677.90	0.68	a)
US003CVR0169	ABIOMED INC-CVR	729	0	0	729 USD	0.00	0.00	0.00	c)
US00507V1098	ACTIVISION BLIZZARD INC	13'283	2'561	15'844	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00724F1012	ADOBE INC	7'387	963	1'024	7'326 USD	560.28	4'104'611.28	0.56	a)
US00751Y1064	ADVANCE AUTO PARTS INC	1'064	0	1'064	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00766T1007	AECOM	2'115	0	0	2'115 USD	88.83	187'875.45	0.03	a)
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	25'731	4'159	3'907	25'983 USD	192.53	5'002'506.99	0.68	a)
US00846U1016	AGILENT TECHNOLOGIES INC	4'073	1'770	1'072	4'771 USD	137.36	655'344.56	0.09	a)
US0090661010	AIRBNB INC-CLASS A	6'079	2'258	1'098	7'239 USD	157.47	1'139'925.33	0.15	a)
US0091581068	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3'732	0	0	3'732 USD	234.04	873'437.28	0.12	a)
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2'952	0	634	2'318 USD	110.92	257'112.56	0.03	a)
US0126531013	ALBEMARLE CORP	1'686	585	578	1'693 USD	137.85	233'380.05	0.03	a)
US0130911037	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	0	6'465	0	6'465 USD	20.28	131'110.20	0.02	a)
US0138721065	ALCOA CORP	3'168	0	3'168	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0152711091	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2'024	1'011	0	3'035 USD	124.73	378'555.55	0.05	a)
US0162551016	ALIGN TECHNOLOGY INC	1'305	0	0	1'305 USD	302.42	394'658.10	0.05	a)
US0188021085	ALLIANT ENERGY CORP	2'912	2'346	2'427	2'831 USD	47.75	135'180.25	0.02	a)
US0200021014	ALLSTATE CORP	4'454	0	0	4'454 USD	159.52	710'502.08	0.10	a)
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	3'381	0	0	3'381 USD	36.99	125'063.19	0.02	a)
US02043Q1076	ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1'857	662	659	1'860 USD	151.09	281'027.40	0.04	a)
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	88'695	10'202	15'206	83'691 USD	139.78	11'698'327.98	1.59	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	96'342	13'018	12'411	96'949 USD	138.46	13'423'558.54	1.82	a)
US0220951033	ALTRIA GROUP INC	29'580	2'960	2'772	29'768 USD	40.91	1'217'808.88	0.17	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	146'908	22'896	18'232	151'572 USD	176.76	26'791'866.72	3.64	a)
US0235865062	AMERCO-NON VOTING	1'413	0	0	1'413 USD	63.57	89'824.41	0.01	a)
US0236081024	AMEREN CORPORATION	4'937	0	0	4'937 USD	71.19	351'465.03	0.05	a)
US0255371017	AMERICAN ELECTRIC POWER	7'964	1'762	1'507	8'219 USD	85.19	700'176.61	0.10	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	10'314	1'071	1'545	9'840 USD	219.42	2'159'092.80	0.29	a)
US0259321042	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1'519	0	0	1'519 USD	127.67	193'930.73	0.03	a)
US02665T3068	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6'245	0	4'015	2'230 USD	37.01	82'532.30	0.01	a)
US0268747849	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	12'533	0	2'033	10'500 USD	72.89	765'345.00	0.10	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	7'346	1'048	661	7'733 USD	198.86	1'537'784.38	0.21	a)
US0304201033	AMERICAN WATER WORKS CO INC	2'909	0	0	2'909 USD	118.54	344'832.86	0.05	a)
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	2'345	2'028	1'471	2'902 USD	235.60	683'711.20	0.09	a)
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1'563	671	631	1'603 USD	407.36	652'998.08	0.09	a)
US0311001004	AMETEK INC	3'481	1'459	881	4'059 USD	180.18	731'350.62	0.10	a)
US0311621009	AMGEN INC	8'488	1'657	1'625	8'520 USD	273.83	2'333'031.60	0.32	a)
US0320951017	AMPHENOL CORP-CL A	9'533	0	0	9'533 USD	109.24	1'041'384.92	0.14	a)
US0326541051	ANALOG DEVICES INC	8'330	852	1'465	7'717 USD	191.82	1'480'274.94	0.20	a)
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	7'314	0	0	7'314 USD	19.09	139'624.26	0.02	a)
US03662Q1058	ANSYS INC	1'342	0	0	1'342 USD	334.17	448'456.14	0.06	a)
US0367521038	ANTHEM INC	3'863	432	331	3'964 USD	501.25	1'986'955.00	0.27	a)
US03743Q1085	APA CORP	5'632	0	0	5'632 USD	29.79	167'777.28	0.02	a)
US03769M1062	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	6'926	0	0	6'926 USD	111.80	774'326.80	0.11	a)
US0378331005	APPLE INC	257'719	32'945	50'609	240'055 USD	180.75	43'389'941.25	5.89	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	14'055	1'259	1'892	13'422 USD	201.62	2'706'143.64	0.37	a)
US03831W1080	APPLOVIN CORP-CLASS A	0	2'505	0	2'505 USD	59.72	149'598.60	0.02	a)
US03852U1060	ARAMARK	1'876	5'557	7'433	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	8'424	2'679	1'752	9'351 USD	53.11	496'631.61	0.07	a)
US03990B1017	ARES MANAGEMENT CORP - A	2'288	0	0	2'288 USD	132.63	303'457.44	0.04	a)
US0404131064	ARISTA NETWORKS INC	4'080	1'167	1'279	3'968 USD	277.54	1'101'278.72	0.15	a)
US0427351004	ARROW ELECTRONICS INC	451	1'069	1'520	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US04621X1081	ASSURANT INC	1'129	0	0	1'129 USD	181.45	204'857.05	0.03	a)
US0477263026	ATLANTA BRAVES HOLDINGS IN-C	0	84	84	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0495601058	ATMOS ENERGY CORP	2'215	0	0	2'215 USD	112.91	250'095.65	0.03	a)
US0527691069	AUTODESK INC	3'241	1'000	630	3'611 USD	258.17	932'251.87	0.13	a)
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	6'443	956	583	6'816 USD	251.13	1'711'702.08	0.23	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	307	52	53	306 USD	3'006.02	919'842.12	0.12	a)
US0534841012	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1'847	1'214	699	2'362 USD	177.03	418'144.86	0.06	a)
US05352A1007	AVANTOR INC	11'203	0	0	11'203 USD	24.64	276'041.92	0.04	a)
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	1'491	0	382	1'109 USD	216.53	240'131.77	0.03	a)
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	1'085	578	0	1'663 USD	307.37	511'156.31	0.07	a)
US05722G1004	BAKER HUGHES A GE CO	16'651	0	0	16'651 USD	29.59	492'703.09	0.07	a)
US0584981064	BALL CORP	5'223	0	0	5'223 USD	64.02	334'376.46	0.05	a)
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	117'148	13'015	14'444	115'719 USD	34.52	3'994'619.88	0.54	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	13'214	0	2'611	10'603 USD	56.09	594'722.27	0.08	a)
US0708301041	BATH & BODY WORKS INC	4'079	0	0	4'079 USD	45.70	186'410.30	0.03	a)
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	6'913	3'270	2'997	7'186 USD	40.92	294'051.12	0.04	a)
US0758871091	BECTON DICKINSON AND CO	4'772	527	515	4'784 USD	235.55	1'126'871.20	0.15	a)
US08265T2087	BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	1'483	3'061	1'395	3'149 USD	51.37	161'764.13	0.02	a)
US0844231029	WR BERKLEY CORP	3'792	0	0	3'792 USD	83.60	317'011.20	0.04	a)
US0846707026	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	20'807	3'543	2'943	21'407 USD	409.40	8'764'025.80	1.19	a)
US0865161014	BEST BUY CO INC	3'771	0	0	3'771 USD	80.88	304'998.48	0.04	a)
US0900431000	BILL HOLDINGS INC	1'805	0	0	1'805 USD	63.33	114'310.65	0.02	a)
US0905722072	BIO-RAD LABORATORIES-A	404	0	0	404 USD	325.88	131'655.52	0.02	a)
US09061G1013	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2'962	0	0	2'962 USD	86.28	255'561.36	0.03	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	2'435	0	0	2'435 USD	216.99	528'370.65	0.07	a)
US09073M1045	BIO-TECHNE CORP	2'352	0	0	2'352 USD	73.57	173'036.64	0.02	a)
US09215C1053	BLACK KNIGHT INC	1'758	2'254	4'012	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09247X1019	BLACKROCK INC	2'382	301	196	2'487 USD	811.34	2'017'802.58	0.27	a)
US09260D1072	BLACKSTONE INC	11'188	2'241	2'572	10'857 USD	127.82	1'387'741.74	0.19	a)
US0970231058	BOEING CO/THE	9'477	1'557	966	10'068 USD	203.72	2'051'052.96	0.28	a)
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	654	51	138	567 USD	3'468.83	1'966'826.61	0.27	a)
US0995021062	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2'036	0	0	2'036 USD	147.71	300'737.56	0.04	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	4'208	0	0	4'208 USD	31.13	130'995.04	0.02	a)
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	2'364	0	0	2'364 USD	64.72	152'998.08	0.02	a)
US1011371077	BOSTON SCIENTIFIC CORP	23'258	5'172	5'094	23'336 USD	66.21	1'545'076.56	0.21	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	34'194	5'836	5'458	34'572 USD	50.75	1'754'529.00	0.24	a)
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	1'416	913	385	1'944 USD	203.58	395'759.52	0.05	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	6'601	1'367	719	7'249 USD	1'300.49	9'427'252.01	1.28	a)
US1152361010	BROWN & BROWN INC	4'215	0	0	4'215 USD	84.21	354'945.15	0.05	a)
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3'775	2'011	2'484	3'302 USD	60.23	198'879.46	0.03	a)
US12008R1077	BUILDERS FIRSTSOURCE INC	0	2'364	757	1'607 USD	195.18	313'654.26	0.04	a)
US1220171060	BURLINGTON STORES INC	1'233	0	0	1'233 USD	205.10	252'888.30	0.03	a)
US12503M1080	CBOE GLOBAL MARKETS INC	1'909	0	0	1'909 USD	192.00	366'528.00	0.05	a)
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	4'838	0	0	4'838 USD	91.89	444'563.82	0.06	a)
US12514G1085	CDW CORP/DE	2'293	0	0	2'293 USD	246.21	564'559.53	0.08	a)
US1252691001	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3'120	0	0	3'120 USD	80.72	251'846.40	0.03	a)
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1'391	1'278	1'350	1'319 USD	74.08	97'711.52	0.01	a)
US1255231003	THE CIGNA GROUP	4'874	725	965	4'634 USD	336.14	1'557'672.76	0.21	a)
US12572Q1058	CME GROUP INC	6'000	670	686	5'984 USD	220.35	1'318'574.40	0.18	a)
US1258961002	CMS ENERGY CORP	5'381	0	0	5'381 USD	57.37	308'707.97	0.04	a)
US1264081035	CSX CORP	33'047	5'682	8'048	30'681 USD	37.94	1'164'037.14	0.16	a)
US1266501006	CVS HEALTH CORP	21'237	2'660	1'935	21'962 USD	74.37	1'633'313.94	0.22	a)
US1270971039	CABOT OIL & GAS CORP	11'784	5'337	5'058	12'063 USD	25.78	310'984.14	0.04	a)
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	4'100	831	532	4'399 USD	304.38	1'338'967.62	0.18	a)
US12769G1004	CAESARS ENTERTAINMENT INC	3'510	0	0	3'510 USD	43.47	152'579.70	0.02	a)
US1331311027	CAMDEN PROPERTY TRUST	1'994	0	0	1'994 USD	94.48	188'393.12	0.03	a)
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	4'232	0	0	4'232 USD	42.64	180'452.48	0.02	a)
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6'379	0	0	6'379 USD	137.61	877'814.19	0.12	a)
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	4'864	0	697	4'167 USD	111.98	466'620.66	0.06	a)
US1423391002	CARLISLE COS INC	953	0	0	953 USD	350.00	333'550.00	0.05	a)
US1431301027	CARMAX INC	2'466	0	0	2'466 USD	79.00	194'814.00	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US14316J1088	CARLYLE GROUP INC/THE	2'923	0	0	2'923 USD	45.85	134'019.55	0.02	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	14'651	0	2'653	11'998 USD	55.58	666'848.84	0.09	a)
US1488061029	CATALENT INC	1'691	1'762	0	3'453 USD	57.34	197'995.02	0.03	a)
US1491231015	CATERPILLAR INC	8'603	768	1'116	8'255 USD	333.96	2'756'839.80	0.37	a)
US1508701034	CELANESE CORP	1'711	0	0	1'711 USD	151.97	260'020.67	0.04	a)
US15118V2079	CELSIUS HOLDINGS INC	0	2'521	0	2'521 USD	81.62	205'764.02	0.03	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	8'485	1'986	1'903	8'568 USD	78.43	671'988.24	0.09	a)
US15189T1079	CENTERPOINT ENERGY INC	11'027	5'336	5'289	11'074 USD	27.50	304'535.00	0.04	a)
US15677J1088	CERIDIAN HCM HOLDING INC	2'248	0	0	2'248 USD	69.76	156'820.48	0.02	a)
US1598641074	CHARLES RIVER LABORATORIES	817	0	0	817 USD	254.19	207'673.23	0.03	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1'723	362	390	1'695 USD	293.93	498'211.35	0.07	a)
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	3'644	2'241	1'699	4'186 USD	155.20	649'667.20	0.09	a)
US1651677353	CHESAPEAKE ENERGY CORP	1'587	0	0	1'587 USD	82.78	131'371.86	0.02	a)
US1667641005	CHEVRON CORP	30'122	4'044	5'042	29'124 USD	152.01	4'427'139.24	0.60	a)
US16679L1098	CHEWY INC - CLASS A	1'896	0	1'896	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	409	116	59	466 USD	2'688.77	1'252'966.82	0.17	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	4'207	0	0	4'207 USD	100.12	421'204.84	0.06	a)
US1720621010	CINCINNATI FINANCIAL CORP	1'935	1'132	729	2'338 USD	114.00	266'532.00	0.04	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	65'898	8'342	6'695	67'545 USD	48.37	3'267'151.65	0.44	a)
US1729081059	CINTAS CORP	1'463	0	0	1'463 USD	628.61	919'656.43	0.12	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	31'881	3'408	5'753	29'536 USD	55.49	1'638'952.64	0.22	a)
US1746101054	CITIZENS FINANCIAL GROUP	7'261	0	0	7'261 USD	31.39	227'922.79	0.03	a)
US1858991011	CLEVELAND-CLIFFS INC	8'610	0	0	8'610 USD	20.80	179'088.00	0.02	a)
US1890541097	CLOROX COMPANY	1'768	810	764	1'814 USD	153.31	278'104.34	0.04	a)
US18915M1071	CLOUDFLARE INC - CLASS A	4'726	0	0	4'726 USD	98.54	465'700.04	0.06	a)
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	67'303	7'756	8'026	67'033 USD	60.02	4'023'320.66	0.55	a)
US1924221039	COGNEX CORP	2'297	0	2'297	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7'615	2'148	1'987	7'776 USD	79.02	614'459.52	0.08	a)
US19260Q1076	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	2'394	724	0	3'118 USD	203.56	634'700.08	0.09	a)
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	12'009	2'882	1'734	13'157 USD	86.52	1'138'343.64	0.15	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	71'195	6'417	12'479	65'133 USD	42.85	2'790'949.05	0.38	a)
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	8'130	0	0	8'130 USD	28.08	228'290.40	0.03	a)
US20717M1036	CONFLUENT INC-CLASS A	0	2'623	0	2'623 USD	33.87	88'841.01	0.01	a)
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	20'190	2'723	3'170	19'743 USD	112.54	2'221'877.22	0.30	a)
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	5'831	1'303	1'316	5'818 USD	87.21	507'387.78	0.07	a)
US21036P1084	CONSTELLATION BRANDS INC-A	2'407	582	524	2'465 USD	248.52	612'601.80	0.08	a)
US21037T1097	CONSTELLATION ENERGY	4'823	3'809	3'886	4'746 USD	168.45	799'463.70	0.11	a)
US2166484020	COOPER COS INC/THE	793	0	793	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2166485019	COOPER COS INC/THE	0	3'172	0	3'172 USD	93.60	296'899.20	0.04	a)
US2172041061	COPART INC	7'019	14'038	7'019	14'038 USD	53.15	746'119.70	0.10	a)
US21871X1090	COREBRIDGE FINANCIAL INC	0	5'947	0	5'947 USD	24.83	147'664.01	0.02	a)
US2193501051	CORNING INC	11'894	3'764	4'003	11'655 USD	32.24	375'757.20	0.05	a)
US22052L1044	CORTEVA INC	11'314	2'203	2'294	11'223 USD	53.52	600'654.96	0.08	a)
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	6'996	884	705	7'175 USD	743.89	5'337'410.75	0.72	a)
US22160N1090	COSTAR GROUP INC	5'687	2'899	1'550	7'036 USD	87.03	612'343.08	0.08	a)
US22788C1053	CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2'914	940	0	3'854 USD	324.15	1'249'274.10	0.17	a)
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	7'350	0	0	7'350 USD	109.94	808'059.00	0.11	a)
US2283681060	CROWN HOLDINGS INC	1'896	0	0	1'896 USD	76.62	145'271.52	0.02	a)
US2310211063	CUMMINS INC	2'239	882	1'086	2'035 USD	268.61	546'621.35	0.07	a)
US23331A1097	DR HORTON INC	5'189	1'279	1'177	5'291 USD	149.44	790'687.04	0.11	a)
US2333311072	DTE ENERGY COMPANY	3'465	0	0	3'465 USD	108.35	375'432.75	0.05	a)
US2358511028	DANAHER CORP	11'145	1'488	1'068	11'565 USD	253.14	2'927'564.10	0.40	a)
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	2'337	0	863	1'474 USD	170.71	251'626.54	0.03	a)
US2372661015	DARLING INGREDIENTS INC	2'274	0	0	2'274 USD	42.31	96'212.94	0.01	a)
US23804L1035	DATADOG INC - CLASS A	4'285	0	0	4'285 USD	131.46	563'306.10	0.08	a)
US23918K1088	DAVITA INC	1'388	0	737	651 USD	126.97	82'657.47	0.01	a)
US2435371073	DECKERS OUTDOOR CORP	0	445	0	445 USD	895.59	398'537.55	0.05	a)
US2441991054	DEERE & CO	4'670	467	599	4'538 USD	365.05	1'656'596.90	0.22	a)
US24703L2025	DELL TECHNOLOGIES -C	3'535	1'116	1'558	3'093 USD	94.66	292'783.38	0.04	a)
US2473617023	DELTA AIR LINES INC	4'275	2'374	3'397	3'252 USD	42.27	137'462.04	0.02	a)
US24906P1093	DENTSPLY SIRONA INC	4'748	0	4'748	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	9'036	2'712	1'635	10'113 USD	44.06	445'578.78	0.06	a)
US2521311074	DEXCOM INC	6'542	0	0	6'542 USD	115.07	752'787.94	0.10	a)
US25278X1090	DIAMONDBACK ENERGY INC	3'052	808	822	3'038 USD	182.52	554'495.76	0.08	a)
US2533931026	DICK'S SPORTING GOODS INC	0	1'049	0	1'049 USD	177.89	186'606.61	0.03	a)
US2538681030	DIGITAL REALTY TRUST INC	4'142	1'217	1'018	4'341 USD	146.81	637'302.21	0.09	a)
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	29'697	3'772	4'024	29'445 USD	111.58	3'285'473.10	0.45	a)
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3'966	1'314	1'258	4'022 USD	120.70	485'455.40	0.07	a)
US25470M1099	DISH NETWORK CORP-A	5'090	0	5'090	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2561631068	DOCUSIGN INC	3'803	0	0	3'803 USD	53.27	202'585.81	0.03	a)
US2566771059	DOLLAR GENERAL CORP	3'475	631	0	4'106 USD	145.31	596'642.86	0.08	a)
US2567461080	DOLLAR TREE INC	3'347	903	954	3'296 USD	146.68	483'457.28	0.07	a)
US25746U1097	DOMINION ENERGY INC	12'790	4'320	2'490	14'620 USD	47.83	699'274.60	0.09	a)
US25754A2015	DOMINO'S PIZZA INC	449	400	383	466 USD	448.35	208'931.10	0.03	a)
US25809K1051	DOORDASH INC - A	3'439	1'013	0	4'452 USD	124.57	554'585.64	0.08	a)
US2600031080	DOVER CORP	2'024	0	0	2'024 USD	165.38	334'729.12	0.05	a)
US2605571031	DOW INC	11'401	2'464	2'347	11'518 USD	55.88	643'625.84	0.09	a)
US26142V1052	DRAFTKINGS INC-CL A	0	5'971	0	5'971 USD	43.32	258'663.72	0.04	a)
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	6'508	0	6'092	416 USD	23.95	9'963.20	0.00	a)
US26441C2044	DUKE ENERGY CORP	13'841	0	1'601	12'240 USD	91.83	1'123'999.20	0.15	a)
US26614N1028	DUPONT DE NEMOURS INC	8'065	0	2'087	5'978 USD	69.19	413'617.82	0.06	a)
US2681501092	DYNATRACE INC	4'218	0	0	4'218 USD	49.55	209'001.90	0.03	a)
US26875P1012	EOG RESOURCES INC	9'269	1'828	1'143	9'954 USD	114.46	1'139'334.84	0.15	a)
US26884L1098	EQT CORP	6'178	0	0	6'178 USD	37.15	229'512.70	0.03	a)
US2774321002	EASTMAN CHEMICAL CO	911	2'517	1'589	1'839 USD	87.74	161'353.86	0.02	a)
US2786421030	EBAY INC	7'750	3'027	2'856	7'921 USD	47.28	374'504.88	0.05	a)
US2788651006	ECOLAB INC	4'073	0	0	4'073 USD	224.84	915'773.32	0.12	a)
US2810201077	EDISON INTERNATIONAL	6'225	0	0	6'225 USD	68.02	423'424.50	0.06	a)
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9'574	1'532	1'450	9'656 USD	84.87	819'504.72	0.11	a)
US28414H1032	ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5'754	0	5'754	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	4'296	1'105	998	4'403 USD	139.48	614'130.44	0.08	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	9'247	1'587	1'557	9'277 USD	106.85	991'247.45	0.13	a)
US29109X1063	ASPEN TECHNOLOGY INC	492	0	0	492 USD	193.89	95'393.88	0.01	a)
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	2'024	624	681	1'967 USD	127.01	249'828.67	0.03	a)
US29362U1043	ENTEGRIS INC	1'656	2'695	2'336	2'015 USD	134.36	270'735.40	0.04	a)
US29364G1031	ENTERGY CORP	2'583	2'857	1'451	3'989 USD	101.57	405'162.73	0.05	a)
US29414B1044	EPAM SYSTEMS INC	999	0	0	999 USD	304.40	304'095.60	0.04	a)
US29430C1027	VESTIS CORP	0	2'219	2'219	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2944291051	EQUIFAX INC	1'624	625	339	1'910 USD	273.59	522'556.90	0.07	a)
US29444U7000	EQUINIX INC	1'425	502	332	1'595 USD	888.82	1'417'667.90	0.19	a)
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	4'704	5'047	5'247	4'504 USD	34.24	154'216.96	0.02	a)
US29472R1086	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3'371	0	0	3'371 USD	67.32	226'935.72	0.03	a)
US29476L1070	EQUITY RESIDENTIAL	4'603	3'492	2'006	6'089 USD	60.21	366'618.69	0.05	a)
US29530P1021	ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	256	267	0	523 USD	406.88	212'798.24	0.03	a)
US29670G1022	ESSENTIAL UTILITIES INC	3'066	0	0	3'066 USD	34.78	106'635.48	0.01	a)
US2971781057	ESSEX PROPERTY TRUST INC	787	592	564	815 USD	231.40	188'591.00	0.03	a)
US29786A1060	ETSY INC	2'318	0	0	2'318 USD	71.69	166'177.42	0.02	a)
US30034W1062	EVERGY INC	4'249	0	0	4'249 USD	49.54	210'495.46	0.03	a)
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	4'727	1'634	0	6'361 USD	58.70	373'390.70	0.05	a)
US30063P1057	EXACT SCIENCES CORP	2'929	0	0	2'929 USD	57.53	168'505.37	0.02	a)
US30161N1019	EXELON CORP	16'583	0	0	16'583 USD	35.84	594'334.72	0.08	a)
US30212P3038	EXPEDIA GROUP INC	2'504	0	0	2'504 USD	136.82	342'597.28	0.05	a)
US3021301094	EXPEDITORS INTL WASH INC	2'769	0	614	2'155 USD	119.60	257'738.00	0.03	a)
US30225T1025	EXTRA SPACE STORAGE INC	1'951	2'381	822	3'510 USD	140.97	494'804.70	0.07	a)
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	67'502	8'075	10'181	65'396 USD	104.52	6'835'189.92	0.93	a)
US3024913036	FMC CORP	2'366	0	0	2'366 USD	56.39	133'418.74	0.02	a)
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	36'617	4'639	5'014	36'242 USD	490.13	17'763'291.46	2.41	a)
US3030751057	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	711	0	0	711 USD	462.58	328'894.38	0.04	a)
US3032501047	FAIR ISAAC CORP	483	0	68	415 USD	1'269.91	527'012.65	0.07	a)
US3119001044	FASTENAL CO	9'183	3'668	2'360	10'491 USD	73.01	765'947.91	0.10	a)
US31428X1063	FEDEX CORP	3'562	838	569	3'831 USD	248.97	953'804.07	0.13	a)
US3156161024	F5 INC	924	0	0	924 USD	187.22	172'991.28	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	9'267	0	0	9'267 USD	69.19	641'183.73	0.09	a)
US31620R3030	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	2'957	0	0	2'957 USD	50.58	149'565.06	0.02	a)
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	8'641	7'914	4'985	11'570 USD	34.34	397'313.80	0.05	a)
US31946M1036	FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	220	63	100	183 USD	1'573.81	288'007.23	0.04	a)
US3205171057	FIRST HORIZON CORP	11'030	0	11'030	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US33616C1009	FIRST REPUBLIC BANK/CA	3'039	0	3'039	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3364331070	FIRST SOLAR INC	1'493	0	0	1'493 USD	153.89	229'757.77	0.03	a)
US3377381088	FISERV INC	10'145	1'150	2'078	9'217 USD	149.27	1'375'821.59	0.19	a)
US3379321074	FIRSTENERGY CORP	9'118	0	0	9'118 USD	36.61	333'809.98	0.05	a)
US3390411052	FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1'214	0	0	1'214 USD	279.27	339'033.78	0.05	a)
US3453708600	FORD MOTOR CO	59'540	10'768	8'523	61'785 USD	12.44	768'605.40	0.10	a)
US34959E1091	FORTINET INC	9'869	3'369	1'800	11'438 USD	69.11	790'480.18	0.11	a)
US34959J1088	FORTIVE CORP	4'496	1'915	0	6'411 USD	85.13	545'768.43	0.07	a)
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	2'223	0	0	2'223 USD	81.34	180'818.82	0.02	a)
US34965K1079	FORTREA HOLDINGS INC	0	1'266	1'266	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	7'059	0	0	7'059 USD	29.79	210'287.61	0.03	a)
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	1'602	0	0	1'602 USD	27.38	43'862.76	0.01	a)
US3546131018	FRANKLIN RESOURCES INC	3'780	0	0	3'780 USD	27.45	103'761.00	0.01	a)
US35671D8570	FREEMPORT-MCMORAN INC	22'056	5'654	3'484	24'226 USD	37.81	915'985.06	0.12	a)
US36266G1076	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	6'178	0	0	6'178 USD	91.28	563'927.84	0.08	a)
US3635761097	ARTHUR J GALLAGHER & CO	3'624	0	0	3'624 USD	243.93	884'002.32	0.12	a)
US36467J1088	GAMING AND LEISURE PROPRTIE	4'712	0	0	4'712 USD	45.48	214'301.76	0.03	a)
US3666511072	GARTNER INC	1'140	635	395	1'380 USD	465.56	642'472.80	0.09	a)
US3687361044	GENERAC HOLDINGS INC	1'291	0	1'291	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3695501086	GENERAL DYNAMICS CORP	5'532	0	599	4'933 USD	273.25	1'347'942.25	0.18	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	18'534	1'364	2'287	17'611 USD	156.89	2'762'989.79	0.37	a)
US3703341046	GENERAL MILLS INC	9'500	1'559	1'473	9'586 USD	64.18	615'229.48	0.08	a)
US37045V1008	GENERAL MOTORS CO	20'962	7'110	3'742	24'330 USD	40.98	997'043.40	0.14	a)
US3724601055	GENUINE PARTS CO	2'412	0	0	2'412 USD	149.26	360'015.12	0.05	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	20'132	3'992	3'375	20'749 USD	72.10	1'496'002.90	0.20	a)
US37940X1028	GLOBAL PAYMENTS INC	3'981	1'243	1'194	4'030 USD	129.70	522'691.00	0.07	a)
US37959E1029	GLOBE LIFE INC	1'699	0	0	1'699 USD	126.93	215'654.07	0.03	a)
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	2'470	0	0	2'470 USD	114.15	281'950.50	0.04	a)
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5'513	950	978	5'485 USD	389.05	2'133'939.25	0.29	a)
US3841091040	GRACO INC	2'706	0	0	2'706 USD	91.26	246'949.56	0.03	a)
US3848021040	WW GRAINGER INC	708	184	189	703 USD	973.46	684'342.38	0.09	a)
US4039491000	HF SINCLAIR CORP	2'603	0	0	2'603 USD	55.50	144'466.50	0.02	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	3'541	0	466	3'075 USD	311.70	958'477.50	0.13	a)
US40434L1052	HP INC	15'826	0	0	15'826 USD	28.33	448'350.58	0.06	a)
US4062161017	HALLIBURTON CO	14'712	0	0	14'712 USD	35.07	515'949.84	0.07	a)
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4'927	1'828	1'804	4'951 USD	95.84	474'503.84	0.06	a)
US4180561072	HASBRO INC	2'753	0	0	2'753 USD	50.29	138'448.37	0.02	a)
US42226K1051	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	7'518	0	7'518	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42250P1030	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5'837	5'866	0	11'703 USD	16.75	196'025.25	0.03	a)
US4228061093	HEICO CORP	3'573	473	1'554	2'492 USD	193.40	481'952.80	0.07	a)
US4228062083	HEICO CORP-CLASS A	1'895	0	1'304	591 USD	155.59	91'953.69	0.01	a)
US4262811015	JACK HENRY & ASSOCIATES INC	992	0	0	992 USD	173.77	172'379.84	0.02	a)
US4278661081	HERSHEY CO/THE	2'734	0	476	2'258 USD	187.92	424'323.36	0.06	a)
US42809H1077	HESS CORP	4'164	2'055	1'832	4'387 USD	145.75	639'405.25	0.09	a)
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	22'940	0	0	22'940 USD	15.23	349'376.20	0.05	a)
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4'300	907	955	4'252 USD	204.32	868'768.64	0.12	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	4'405	0	0	4'405 USD	73.80	325'089.00	0.04	a)
US4370761029	HOME DEPOT INC	16'438	1'580	1'955	16'063 USD	380.61	6'113'738.43	0.83	a)
US4385161066	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11'459	1'731	1'653	11'537 USD	198.73	2'292'748.01	0.31	a)
US4404521001	HORMEL FOODS CORP	5'395	0	0	5'395 USD	35.32	190'551.40	0.03	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	11'894	0	0	11'894 USD	20.74	246'681.56	0.03	a)
US4432011082	HOWMET AEROSPACE INC	12'401	1'701	6'242	7'860 USD	66.55	523'083.00	0.07	a)
US4435106079	HUBBELL INC	774	0	0	774 USD	380.67	294'638.58	0.04	a)
US4435731009	HUBSPOT INC	846	0	0	846 USD	618.81	523'513.26	0.07	a)
US4448591028	HUMANA INC	2'090	254	262	2'082 USD	350.32	729'366.24	0.10	a)
US4456581077	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1'460	0	0	1'460 USD	206.31	301'212.60	0.04	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	26'165	0	0	26'165 USD	13.04	341'191.60	0.05	a)
US4464131063	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2'573	0	643	1'930 USD	291.62	562'826.60	0.08	a)
US4485791028	HYATT HOTELS CORP - CL A	0	1'195	965	230 USD	153.59	35'325.70	0.00	a)
US45167R1041	IDEX CORP	1'276	0	0	1'276 USD	235.90	301'008.40	0.04	a)
US45168D1046	IDEX LABORATORIES INC	1'347	0	0	1'347 USD	575.23	774'834.81	0.11	a)
US4523081093	ILLINOIS TOOL WORKS	4'986	545	540	4'991 USD	262.15	1'308'390.65	0.18	a)
US4523271090	ILLUMINA INC	2'204	567	0	2'771 USD	139.83	387'468.93	0.05	a)
US45337C1027	INCYTE CORP	3'205	0	0	3'205 USD	58.36	187'043.80	0.03	a)
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	6'917	0	0	6'917 USD	91.33	631'729.61	0.09	a)
US45784P1012	INSULET CORP	1'136	0	0	1'136 USD	164.00	186'304.00	0.03	a)
US4581401001	INTEL CORP	66'003	13'001	9'304	69'700 USD	43.05	3'000'585.00	0.41	a)
US45866F1049	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	8'937	3'009	2'217	9'729 USD	138.42	1'346'688.18	0.18	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	14'388	3'061	2'174	15'275 USD	185.03	2'826'333.25	0.38	a)
US4595061015	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4'249	0	0	4'249 USD	75.50	320'799.50	0.04	a)
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	6'370	0	0	6'370 USD	35.36	225'243.20	0.03	a)
US4606901001	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	4'794	9'732	6'797	7'729 USD	31.40	242'690.60	0.03	a)
US4612021034	INTUIT INC	4'224	677	281	4'620 USD	662.89	3'062'551.80	0.42	a)
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	5'591	661	423	5'829 USD	385.60	2'247'662.40	0.31	a)
US46187W1071	INVITATION HOMES INC	10'832	0	0	10'832 USD	34.07	369'046.24	0.05	a)
US46266C1053	IQVIA HOLDINGS INC	2'936	1'293	1'275	2'954 USD	247.16	730'110.64	0.10	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	3'725	3'762	2'318	5'169 USD	78.64	406'490.16	0.06	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	47'189	6'995	6'670	47'514 USD	186.06	8'840'454.84	1.20	a)
US4663131039	JABIL INC	0	1'937	0	1'937 USD	144.09	279'102.33	0.04	a)
US46982L1089	JACOBS SOLUTIONS INC	3'587	0	582	3'005 USD	146.65	440'683.25	0.06	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	42'368	4'814	7'719	39'463 USD	161.38	6'368'538.94	0.86	a)
US48203R1041	JUNIPER NETWORKS INC	6'848	0	0	6'848 USD	37.03	253'581.44	0.03	a)
US4824801009	KLA CORP	2'422	172	273	2'321 USD	682.30	1'583'618.30	0.21	a)
US48251W1045	KKR & CO INC	7'620	2'522	982	9'160 USD	98.26	900'061.60	0.12	a)
US4878361082	KELLANOVA	3'826	4'520	2'629	5'717 USD	55.15	315'292.55	0.04	a)
US49177J1025	KENVUE INC	0	23'714	0	23'714 USD	19.00	450'566.00	0.06	a)
US49271V1008	KEURIG DR PEPPER INC	11'232	4'822	0	16'054 USD	29.91	480'175.14	0.07	a)
US4932671088	KEYCORP	10'637	13'086	12'845	10'878 USD	14.27	155'229.06	0.02	a)
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2'641	807	757	2'691 USD	154.30	415'221.30	0.06	a)
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	5'580	0	0	5'580 USD	121.17	676'128.60	0.09	a)
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	9'140	0	0	9'140 USD	19.76	180'606.40	0.02	a)
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	28'556	8'254	4'238	32'572 USD	17.39	566'427.08	0.08	a)
US4990491049	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2'900	0	0	2'900 USD	56.34	163'386.00	0.02	a)
US5007541064	KRAFT HEINZ CO/THE	10'850	3'286	0	14'136 USD	35.28	498'718.08	0.07	a)
US5010441013	KROGER CO	10'375	4'312	2'744	11'943 USD	49.61	592'492.23	0.08	a)
US5018892084	LKQ CORP	4'161	0	0	4'161 USD	52.29	217'578.69	0.03	a)
US50212V1008	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1'423	0	0	1'423 USD	267.89	381'207.47	0.05	a)
US5024311095	L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3'642	1'574	691	4'525 USD	211.66	957'761.50	0.13	a)
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1'266	0	0	1'266 USD	215.83	273'240.78	0.04	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	2'056	378	199	2'235 USD	938.25	2'096'988.75	0.28	a)
US5132721045	LAMB WESTON HOLDINGS INC	2'039	0	0	2'039 USD	102.21	208'406.19	0.03	a)
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	6'315	0	0	6'315 USD	54.52	344'293.80	0.05	a)
US5184151042	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	0	1'907	0	1'907 USD	76.61	146'095.27	0.02	a)
US5184391044	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3'601	1'108	676	4'033 USD	148.58	599'223.14	0.08	a)
US5218652049	LEAR CORP	1'186	0	0	1'186 USD	137.35	162'897.10	0.02	a)
US5253271028	LEIDOS HOLDINGS INC	1'598	2'231	1'575	2'254 USD	127.86	288'196.44	0.04	a)
US5260571048	LENNAR CORP-A	4'812	0	1'143	3'669 USD	158.51	581'573.19	0.08	a)
US5261071071	LENNOX INTERNATIONAL INC	510	0	0	510 USD	471.21	240'317.10	0.03	a)
US5303073051	LIBERTY BROADBAND-C	1'450	0	0	1'450 USD	60.18	87'261.00	0.01	a)
US5312294094	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	2'313	0	2'313	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5312296073	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	710	4'558	5'268	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5312297220	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	0	456	456	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5312297550	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	0	2'893	0	2'893 USD	72.76	210'494.68	0.03	a)
US5312297899	LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	0	1'328	0	1'328 USD	28.98	38'485.44	0.01	a)
US5312298541	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2'893	0	2'893	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5324571083	ELI LILLY & CO	13'032	1'858	1'716	13'174 USD	753.68	9'928'980.32	1.35	a)
US5380341090	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1'911	1'854	1'620	2'145 USD	96.98	208'022.10	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US5404241086	LOEWS CORP	2'533	0	0	2'533 USD	75.13	190'304.29	0.03	a)
US5486611073	LOWE'S COS INC	9'799	776	1'172	9'403 USD	240.67	2'263'020.01	0.31	a)
US5494981039	LUCID GROUP INC	6'528	0	6'528	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US55261F1049	M & T BANK CORP	2'621	0	0	2'621 USD	139.74	366'258.54	0.05	a)
US5529531015	MGM RESORTS INTERNATIONAL	2'822	2'991	1'862	3'951 USD	43.28	170'999.28	0.02	a)
US55354G1004	MSCI INC	1'351	0	0	1'351 USD	560.97	757'870.47	0.10	a)
US5627501092	MANHATTAN ASSOCIATES INC	0	823	0	823 USD	253.33	208'490.59	0.03	a)
US5658491064	MARATHON OIL CORP	9'558	0	0	9'558 USD	24.25	231'781.50	0.03	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	8'631	0	2'559	6'072 USD	169.23	1'027'564.56	0.14	a)
US5705351048	MARKEL GROUP INC	188	0	0	188 USD	1'492.48	280'586.24	0.04	a)
US57060D1081	MARKETAXESS HOLDINGS INC	646	0	0	646 USD	213.41	137'862.86	0.02	a)
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	7'842	969	708	8'103 USD	202.27	1'638'993.81	0.22	a)
US5719032022	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4'558	0	363	4'195 USD	249.87	1'048'204.65	0.14	a)
US5732841060	MARTIN MARIETTA MATERIALS	888	0	0	888 USD	577.71	513'006.48	0.07	a)
US5738741041	MARVELL TECHNOLOGY INC	14'569	0	0	14'569 USD	71.66	1'044'014.54	0.14	a)
US5745991068	MASCO CORP	3'806	0	0	3'806 USD	76.76	292'148.56	0.04	a)
US5747951003	MASIMO CORP	917	0	917	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	13'844	1'719	1'814	13'749 USD	474.76	6'527'475.24	0.89	a)
US57667L1070	MATCH GROUP INC	4'669	0	0	4'669 USD	36.04	168'270.76	0.02	a)
US5797802064	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3'294	1'713	1'530	3'477 USD	68.86	239'426.22	0.03	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	11'909	1'258	1'385	11'782 USD	292.28	3'443'642.96	0.47	a)
US58155Q1031	MCKESSON CORP	2'518	0	317	2'201 USD	521.41	1'147'623.41	0.16	a)
US58463J3041	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12'562	0	12'562	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	41'191	6'183	5'894	41'480 USD	127.15	5'274'182.00	0.72	a)
US59156R1086	METLIFE INC	11'174	2'354	2'516	11'012 USD	69.74	767'976.88	0.10	a)
US5926881054	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	293	176	93	376 USD	1'247.22	468'954.72	0.06	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	113'787	16'147	14'744	115'190 USD	413.64	47'647'191.60	6.47	a)
US5950171042	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	7'993	2'908	1'612	9'289 USD	84.14	781'576.46	0.11	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	16'920	3'865	3'381	17'404 USD	90.61	1'576'976.44	0.21	a)
US59522J1034	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1'549	840	841	1'548 USD	125.68	194'552.64	0.03	a)
US60770K1079	MODERNA INC	5'675	0	0	5'675 USD	92.24	523'462.00	0.07	a)
US6081901042	MOHAWK INDUSTRIES INC	1'193	0	1'193	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60855R1005	MOLINA HEALTHCARE INC	798	226	0	1'024 USD	393.91	403'363.84	0.05	a)
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	3'739	0	1'221	2'518 USD	62.42	157'173.56	0.02	a)
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	22'343	1'874	1'726	22'491 USD	73.07	1'643'417.37	0.22	a)
US60937P1066	MONGODB INC	1'149	0	0	1'149 USD	447.58	514'269.42	0.07	a)
US6098391054	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	784	0	0	784 USD	720.04	564'511.36	0.08	a)
US61174X1090	MONSTER BEVERAGE CORP	5'670	14'979	8'965	11'684 USD	59.10	690'524.40	0.09	a)
US6153691059	MOODY'S CORP	2'414	716	371	2'759 USD	379.42	1'046'819.78	0.14	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	21'198	1'693	1'921	20'970 USD	86.04	1'804'258.80	0.24	a)
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	4'905	0	0	4'905 USD	31.16	152'839.80	0.02	a)
US6200763075	MOTOROLA SOLUTIONS INC	2'724	467	455	2'736 USD	330.39	903'947.04	0.12	a)
US6293775085	NRG ENERGY INC	2'524	1'755	0	4'279 USD	55.32	236'714.28	0.03	a)
US62944T1051	NVR INC	34	23	0	57 USD	7'625.57	434'657.49	0.06	a)
US6311031081	NASDAQ INC	5'985	0	0	5'985 USD	56.20	336'357.00	0.05	a)
US64110D1046	NETAPP INC	4'207	0	820	3'387 USD	89.12	301'849.44	0.04	a)
US64110L1061	NETFLIX INC	7'335	1'142	1'324	7'153 USD	602.92	4'312'686.76	0.59	a)
US64110Y1082	NET LEASE OFFICE PROPERTY	0	219	219	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US64125C1099	NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1'969	0	1'079	890 USD	130.40	116'056.00	0.02	a)
US6512291062	NEWELL BRANDS INC	6'275	0	6'275	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6516391066	NEWMONT CORP	12'269	7'199	0	19'468 USD	31.25	608'375.00	0.08	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	3'870	0	0	3'870 USD	26.88	104'025.60	0.01	a)
US65339F1012	NEXTERA ENERGY INC	32'531	3'111	1'903	33'739 USD	55.19	1'862'055.41	0.25	a)
US6541061031	NIKE INC -CL B	19'744	3'348	3'077	20'015 USD	103.93	2'080'158.95	0.28	a)
US65473P1057	NISOURCE INC	4'238	4'487	0	8'725 USD	26.06	227'373.50	0.03	a)
US6556631025	NORDSON CORP	913	0	0	913 USD	265.65	242'538.45	0.03	a)
US6558441084	NORFOLK SOUTHERN CORP	3'871	0	0	3'871 USD	253.38	980'833.98	0.13	a)
US6658591044	NORTHERN TRUST CORP	2'528	3'249	1'788	3'989 USD	82.13	327'616.57	0.04	a)
US6687711084	NORTONLIFELock INC	11'940	0	0	11'940 USD	21.49	256'590.60	0.03	a)
US6703461052	NUCOR CORP	3'818	1'366	929	4'255 USD	192.30	818'236.50	0.11	a)
US67066G1040	NVIDIA CORP	39'984	5'486	5'148	40'322 USD	791.12	31'899'540.64	4.33	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US67103H1077	O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1'021	153	283	891 USD	1'087.42	968'891.22	0.13	a)
US6745991058	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	11'711	2'125	2'126	11'710 USD	60.61	709'743.10	0.10	a)
US6792951054	OKTA INC	2'274	0	0	2'274 USD	107.30	244'000.20	0.03	a)
US6795801009	OLD DOMINION FREIGHT LINE	1'344	372	191	1'525 USD	442.48	674'782.00	0.09	a)
US6819191064	OMNICOM GROUP	3'913	0	0	3'913 USD	88.39	345'870.07	0.05	a)
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	6'494	1'559	1'405	6'648 USD	78.92	524'660.16	0.07	a)
US6826801036	ONEOK INC	7'094	2'015	0	9'109 USD	75.12	684'268.08	0.09	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	25'587	5'657	3'812	27'432 USD	111.68	3'063'605.76	0.42	a)
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	6'170	1'539	870	6'839 USD	95.30	651'756.70	0.09	a)
US69047Q1022	OVINTIV INC	3'934	0	0	3'934 USD	49.41	194'378.94	0.03	a)
US6907421019	OWENS CORNING	1'153	0	0	1'153 USD	149.78	172'696.34	0.02	a)
US69331C1080	P G & E CORP	24'301	7'805	0	32'106 USD	16.69	535'849.14	0.07	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6'782	0	0	6'782 USD	147.20	998'310.40	0.14	a)
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	3'134	1'594	915	3'813 USD	141.60	539'920.80	0.07	a)
US69351T1060	PPL CORP	9'314	5'088	4'735	9'667 USD	26.37	254'918.79	0.03	a)
US69370C1009	PTC INC	2'008	0	0	2'008 USD	183.01	367'484.08	0.05	a)
US6937181088	PACCAR INC	8'388	1'771	1'708	8'451 USD	110.89	937'131.39	0.13	a)
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	1'647	0	0	1'647 USD	181.19	298'419.93	0.04	a)
US69608A1088	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	29'035	0	0	29'035 USD	25.08	728'197.80	0.10	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	4'804	972	570	5'206 USD	310.55	1'616'723.30	0.22	a)
US7010941042	PARKER HANNIFIN CORP	2'568	0	379	2'189 USD	535.45	1'172'100.05	0.16	a)
US7043261079	PAYCHEX INC	4'816	1'877	1'153	5'540 USD	122.62	679'314.80	0.09	a)
US70432V1026	PAYCOM SOFTWARE INC	900	0	0	900 USD	182.39	164'151.00	0.02	a)
US70438V1061	PAYLOCITY HOLDING CORP	614	0	0	614 USD	168.61	103'526.54	0.01	a)
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	17'531	1'841	1'960	17'412 USD	60.34	1'050'640.08	0.14	a)
US7134481081	PEPSICO INC	22'785	3'163	3'378	22'570 USD	165.34	3'731'723.80	0.51	a)
US7140461093	PERKINELMER INC	2'165	0	0	2'165 USD	109.59	237'262.35	0.03	a)
US7170811035	PFIZER INC	91'098	12'259	9'482	93'875 USD	26.56	2'493'320.00	0.34	a)
US7181721090	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	24'624	4'034	2'643	26'015 USD	89.96	2'340'309.40	0.32	a)
US7185461040	PHILLIPS 66	8'299	0	617	7'682 USD	142.51	1'094'761.82	0.15	a)
US71880K1016	PHINIA INC	0	842	842	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72352L1061	PINTEREST INC- CLASS A	9'845	0	0	9'845 USD	36.70	361'311.50	0.05	a)
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3'898	0	0	3'898 USD	235.19	916'770.62	0.12	a)
US72919P2020	PLUG POWER INC	8'460	0	8'460	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US73278L1052	POOL CORP	746	370	374	742 USD	398.12	295'405.04	0.04	a)
US74144T1088	T ROWE PRICE GROUP INC	3'748	0	0	3'748 USD	113.35	424'835.80	0.06	a)
US74251V1026	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3'681	0	0	3'681 USD	80.86	297'645.66	0.04	a)
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	38'701	5'130	5'401	38'430 USD	158.94	6'108'064.20	0.83	a)
US7433151039	PROGRESSIVE CORP	9'734	1'386	1'724	9'396 USD	189.56	1'781'105.76	0.24	a)
US74340W1036	PROLOGIS INC	14'615	2'778	2'174	15'219 USD	133.27	2'028'236.13	0.28	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5'715	1'601	1'748	5'568 USD	108.99	606'856.32	0.08	a)
US7445731067	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	7'459	3'515	2'074	8'900 USD	62.40	555'360.00	0.08	a)
US74460D1090	PUBLIC STORAGE	2'434	744	442	2'736 USD	283.87	776'668.32	0.11	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	3'693	0	0	3'693 USD	108.38	400'247.34	0.05	a)
US74736K1016	QORVO INC	1'604	0	0	1'604 USD	114.55	183'738.20	0.02	a)
US7475251036	QUALCOMM INC	18'005	2'944	2'203	18'746 USD	157.79	2'957'931.34	0.40	a)
US74762E1029	QUANTA SERVICES INC	1'994	798	717	2'075 USD	241.51	501'133.25	0.07	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	1'706	0	0	1'706 USD	124.89	213'062.34	0.03	a)
US7496851038	RPM INTERNATIONAL INC	2'244	0	0	2'244 USD	115.35	258'845.40	0.04	a)
US7547301090	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3'335	0	0	3'335 USD	120.32	401'267.20	0.05	a)
US75513E1010	RTX CORP	28'162	4'933	5'954	27'141 USD	89.67	2'433'733.47	0.33	a)
US7561091049	REALTY INCOME CORP	10'581	5'502	2'086	13'997 USD	52.11	729'383.67	0.10	a)
US7588491032	REGENCY CENTERS CORP	2'477	0	0	2'477 USD	61.95	153'450.15	0.02	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	1'783	167	171	1'779 USD	966.09	1'718'674.11	0.23	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	15'738	0	0	15'738 USD	18.63	293'198.94	0.04	a)
US7595091023	RELIANCE INC	942	0	0	942 USD	321.22	302'589.24	0.04	a)
US7599161095	REPLIGEN CORP	760	0	0	760 USD	193.99	147'432.40	0.02	a)
US7607591002	REPUBLIC SERVICES INC	3'364	1'443	866	3'941 USD	183.60	723'567.60	0.10	a)
US7611521078	RESMED INC	2'068	1'133	565	2'636 USD	173.72	457'925.92	0.06	a)
US76954A1034	RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	6'840	3'746	0	10'586 USD	11.32	119'833.52	0.02	a)
US7703231032	ROBERT HALF INC	2'184	0	0	2'184 USD	80.40	175'593.60	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US7707001027	ROBINHOOD MARKETS INC - A	0	7'749	0	7'749 USD	16.31	126'386.19	0.02	a)
US7710491033	ROBLOX CORP -CLASS A	4'709	2'768	0	7'477 USD	39.90	298'332.30	0.04	a)
US7739031091	ROCKWELL AUTOMATION INC	1'759	726	446	2'039 USD	285.08	581'278.12	0.08	a)
US77543R1023	ROKU INC	2'115	0	0	2'115 USD	63.18	133'625.70	0.02	a)
US7757111049	ROLLINS INC	4'732	0	0	4'732 USD	44.07	208'539.24	0.03	a)
US7766961061	ROPER TECHNOLOGIES INC	1'655	314	273	1'696 USD	544.73	923'862.08	0.13	a)
US7782961038	ROSS STORES INC	5'259	1'861	1'826	5'294 USD	148.96	788'594.24	0.11	a)
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	5'594	584	1'049	5'129 USD	428.38	2'197'161.02	0.30	a)
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	1'676	0	0	1'676 USD	209.23	350'669.48	0.05	a)
US7841171033	SEI INVESTMENTS COMPANY	2'240	0	1'268	972 USD	67.25	65'367.00	0.01	a)
US78467J1007	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3'636	0	0	3'636 USD	63.76	231'831.36	0.03	a)
US78486Q1013	SVB FINANCIAL GROUP	774	0	774	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE INC	15'704	2'247	2'190	15'761 USD	308.82	4'867'312.02	0.66	a)
US79589L1061	SAMSARA INC-CL A	0	4'375	0	4'375 USD	34.55	151'156.25	0.02	a)
US8064071025	HENRY SCHEIN INC	2'680	0	0	2'680 USD	76.47	204'939.60	0.03	a)
US8085131055	SCHWAB (CHARLES) CORP	23'194	2'808	1'231	24'771 USD	66.78	1'654'207.38	0.22	a)
US81181C1045	SEAGEN INC	2'551	0	2'551	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81211K1007	SEALED AIR CORP	3'030	0	3'030	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8168511090	SEMPRA	4'911	10'640	5'755	9'796 USD	70.60	691'597.60	0.09	a)
US81762P1021	SERVICENOW INC	3'206	407	251	3'362 USD	771.34	2'593'245.08	0.35	a)
US8243481061	SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3'854	569	526	3'897 USD	332.03	1'293'920.91	0.18	a)
US82669G1040	SIGNATURE BANK	1'011	0	1'011	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	5'536	0	969	4'567 USD	148.14	676'555.38	0.09	a)
US82968B1035	SIRIUS XM HOLDINGS INC	11'754	0	0	11'754 USD	4.42	51'952.68	0.01	a)
US83088M1027	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2'953	0	0	2'953 USD	104.92	309'828.76	0.04	a)
US8318652091	SMITH (A.O.) CORP	2'557	0	0	2'557 USD	82.90	211'975.30	0.03	a)
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	2'040	0	0	2'040 USD	120.17	245'146.80	0.03	a)
US8330341012	SNAP-ON INC	1'012	0	0	1'012 USD	275.66	278'967.92	0.04	a)
US83304A1060	SNAP INC - A	22'776	8'469	11'962	19'283 USD	11.02	212'498.66	0.03	a)
US8334451098	SNOWFLAKE INC-CLASS A	3'177	1'722	739	4'160 USD	188.28	783'244.80	0.11	a)
US8425871071	SOUTHERN CO/THE	18'090	2'110	1'720	18'480 USD	67.25	1'242'780.00	0.17	a)
US8447411088	SOUTHWEST AIRLINES CO	3'741	0	0	3'741 USD	34.27	128'204.07	0.02	a)
US8486371045	SPLUNK INC	2'810	0	0	2'810 USD	156.22	438'978.20	0.06	a)
US8522341036	BLOCK INC	8'451	1'671	1'948	8'174 USD	79.47	649'587.78	0.09	a)
US8545021011	STANLEY BLACK & DECKER INC	1'840	4'121	3'239	2'722 USD	89.29	243'047.38	0.03	a)
US8552441094	STARBUCKS CORP	18'147	2'194	1'326	19'015 USD	94.90	1'804'523.50	0.24	a)
US8574771031	STATE STREET CORP	5'122	2'839	2'897	5'064 USD	73.73	373'368.72	0.05	a)
US8581191009	STEEL DYNAMICS INC	2'404	1'181	1'137	2'448 USD	133.82	327'591.36	0.04	a)
US8636671013	STRYKER CORP	5'344	950	917	5'377 USD	349.07	1'876'949.39	0.25	a)
US8666741041	SUN COMMUNITIES INC	1'946	0	0	1'946 USD	133.76	260'296.96	0.04	a)
US86800U1043	SUPER MICRO COMPUTER INC	0	739	0	739 USD	866.12	640'062.68	0.09	a)
US8716071076	SYNOPSIS INC	2'374	364	272	2'466 USD	573.73	1'414'818.18	0.19	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	6'640	0	0	6'640 USD	41.30	274'232.00	0.04	a)
US8718291078	SYSCO CORP	7'597	2'815	1'734	8'678 USD	80.97	702'657.66	0.10	a)
US8725401090	TJX COMPANIES INC	18'733	1'691	1'612	18'812 USD	99.14	1'865'021.68	0.25	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	10'188	887	2'237	8'838 USD	163.30	1'443'245.40	0.20	a)
US8740541094	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2'304	1'086	898	2'492 USD	146.93	366'149.56	0.05	a)
US87612E1064	TARGET CORP	7'528	1'451	1'904	7'075 USD	152.92	1'081'909.00	0.15	a)
US87612G1013	TARGA RESOURCES CORP	3'400	0	0	3'400 USD	98.24	334'016.00	0.05	a)
US8793601050	TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	731	0	0	731 USD	427.27	312'334.37	0.04	a)
US8793691069	TELEFLEX INC	752	0	0	752 USD	222.79	167'538.08	0.02	a)
US8807701029	TERADYNE INC	2'730	0	0	2'730 USD	103.59	282'800.70	0.04	a)
US88160R1014	TESLA INC	42'724	9'740	5'817	46'647 USD	201.88	9'417'096.36	1.28	a)
US8825081040	TEXAS INSTRUMENTS INC	14'932	2'071	2'290	14'713 USD	167.33	2'461'926.29	0.33	a)
US88262P1021	TEXAS PACIFIC LAND CORP	115	0	0	115 USD	1'575.42	181'173.30	0.02	a)
US88339J1051	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6'315	3'222	1'687	7'850 USD	85.43	670'625.50	0.09	a)
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6'274	1'172	1'080	6'366 USD	570.18	3'629'765.88	0.49	a)
US88579Y1010	3M CO	9'151	1'204	1'311	9'044 USD	92.12	833'133.28	0.11	a)
US8887871080	TOAST INC-CLASS A	6'088	0	0	6'088 USD	23.00	140'024.00	0.02	a)
US8910921084	TORO CO	1'670	0	0	1'670 USD	92.31	154'157.70	0.02	a)
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	1'555	1'524	1'140	1'939 USD	254.32	493'126.48	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US8926721064	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	2'303	0	0	2'303 USD	105.82	243'703.46	0.03	a)
US8936411003	TRANSDIGM GROUP INC	1'518	185	541	1'162 USD	1'177.74	1'368'533.88	0.19	a)
US89400J1079	TRANSUNION	3'633	0	0	3'633 USD	77.63	282'029.79	0.04	a)
US89417E1091	TRAVELERS COS INC/THE	4'271	0	659	3'612 USD	220.96	798'107.52	0.11	a)
US8962391004	TRIMBLE INC	3'937	0	0	3'937 USD	61.19	240'905.03	0.03	a)
US89832Q1094	TRUIST FINANCIAL CORP	21'914	0	0	21'914 USD	34.98	766'551.72	0.10	a)
US90138F1021	TWILIO INC - A	3'277	0	0	3'277 USD	59.59	195'276.43	0.03	a)
US9022521051	TYLER TECHNOLOGIES INC	648	0	0	648 USD	437.14	283'266.72	0.04	a)
US9024941034	TYSON FOODS INC-CL A	3'791	2'144	1'559	4'376 USD	54.24	237'354.24	0.03	a)
US9026531049	UDR INC	5'183	0	0	5'183 USD	35.50	183'996.50	0.02	a)
US9026811052	UGI CORP	1'715	0	1'715	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9029733048	US BANCORP	23'516	7'689	5'904	25'301 USD	41.96	1'061'629.96	0.14	a)
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	24'783	8'853	3'211	30'425 USD	79.50	2'418'787.50	0.33	a)
US90364P1057	UIPATH INC - CLASS A	0	7'842	0	7'842 USD	23.75	186'247.50	0.03	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	935	0	175	760 USD	548.56	416'905.60	0.06	a)
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	10'132	1'030	1'037	10'125 USD	253.69	2'568'611.25	0.35	a)
US9113121068	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	12'071	1'910	1'925	12'056 USD	148.26	1'787'422.56	0.24	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	1'145	0	0	1'145 USD	693.27	793'794.15	0.11	a)
US91307C1027	UNITED THERAPEUTICS CORP	731	0	0	731 USD	225.64	164'942.84	0.02	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	15'092	2'410	2'390	15'112 USD	493.60	7'459'283.20	1.01	a)
US91332U1016	UNITY SOFTWARE INC	3'839	0	0	3'839 USD	29.32	112'559.48	0.02	a)
US9139031002	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1'015	0	0	1'015 USD	167.06	169'565.90	0.02	a)
US9182041080	VF CORP	6'205	0	6'205	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91879Q1094	VAIL RESORTS INC	485	0	0	485 USD	230.31	111'700.35	0.02	a)
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	6'822	597	2'211	5'208 USD	141.46	736'723.68	0.10	a)
US9224751084	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1'947	714	0	2'661 USD	225.51	600'082.11	0.08	a)
US92276F1003	VENTAS INC	7'123	0	0	7'123 USD	42.29	301'231.67	0.04	a)
US92338C1036	VERALTO CORP	0	3'855	0	3'855 USD	86.42	333'149.10	0.05	a)
US92343E1029	VERISIGN INC	1'563	0	0	1'563 USD	195.29	305'238.27	0.04	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	69'990	6'522	6'727	69'785 USD	40.02	2'792'795.70	0.38	a)
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	2'225	694	594	2'325 USD	241.90	562'417.50	0.08	a)
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4'179	458	382	4'255 USD	420.74	1'790'248.70	0.24	a)
US92537N1081	VERTIV HOLDINGS CO-A	0	5'759	0	5'759 USD	67.62	389'423.58	0.05	a)
US92556H2067	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	12'066	0	8'193	3'873 USD	11.04	42'757.92	0.01	a)
US92556V1061	VIATRIS INC	20'521	0	0	20'521 USD	12.37	253'844.77	0.03	a)
US9256521090	VICI PROPERTIES INC	17'096	0	0	17'096 USD	29.93	511'683.28	0.07	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	26'277	3'760	4'282	25'755 USD	282.64	7'279'393.20	0.99	a)
US92840M1027	VISTRA CORP	3'903	7'227	5'015	6'115 USD	54.54	333'512.10	0.05	a)
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	3'651	0	3'651	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9291601097	VULCAN MATERIALS CO	2'408	0	0	2'408 USD	265.85	640'166.80	0.09	a)
US92936U1097	WP CAREY INC	3'286	0	0	3'286 USD	56.33	185'100.38	0.03	a)
US92939U1060	WEC ENERGY GROUP INC	5'912	0	981	4'931 USD	78.49	387'034.19	0.05	a)
US92942W1071	WK KELLOGG CO	0	1'439	1'439	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	2'820	0	0	2'820 USD	141.29	398'437.80	0.05	a)
US9311421039	WALMART INC	24'812	76'549	27'903	73'458 USD	58.61	4'305'373.38	0.58	a)
US9314271084	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	11'241	0	0	11'241 USD	21.26	238'983.66	0.03	a)
US9344231041	WARNER BROS DISCOVERY INC	33'160	8'861	0	42'021 USD	8.79	369'364.59	0.05	a)
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	6'570	1'481	1'463	6'588 USD	205.65	1'354'822.20	0.18	a)
US9418481035	WATERS CORP	999	0	0	999 USD	337.42	337'082.58	0.05	a)
US9426222009	WATSCO INC	0	716	193	523 USD	394.12	206'124.76	0.03	a)
US9478901096	WEBSTER FINANCIAL CORP	3'316	0	3'316	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	60'520	7'850	10'588	57'782 USD	55.59	3'212'101.38	0.44	a)
US95040Q1040	WELLTOWER INC	7'891	1'582	0	9'473 USD	92.16	873'031.68	0.12	a)
US9553061055	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1'269	0	0	1'269 USD	358.36	454'758.84	0.06	a)
US9581021055	WESTERN DIGITAL CORP	5'031	0	0	5'031 USD	59.47	299'193.57	0.04	a)
US9604131022	WESTLAKE CORP	712	0	0	712 USD	138.71	98'761.52	0.01	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	3'968	0	0	3'968 USD	45.29	179'710.72	0.02	a)
US9621661043	WEYERHAEUSER CO	13'413	0	0	13'413 USD	34.38	461'138.94	0.06	a)
US9633201069	WHIRLPOOL CORP	1'093	0	1'093	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9694571004	WILLIAMS COS INC	18'576	4'353	4'245	18'684 USD	35.94	671'502.96	0.09	a)
US9699041011	WILLIAMS-SONOMA INC	0	830	0	830 USD	235.53	195'489.90	0.03	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
US9778521024	WOLFSPEED INC	1'832	0	1'832	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	3'485	0	0	3'485 USD	294.66	1'026'890.10	0.14	a)
US9831341071	WYNN RESORTS LTD	1'988	0	0	1'988 USD	105.20	209'137.60	0.03	a)
US98389B1008	XCEL ENERGY INC	9'546	0	0	9'546 USD	52.69	502'978.74	0.07	a)
US98419M1009	XYLEM INC	2'228	2'122	709	3'641 USD	127.05	462'589.05	0.06	a)
US9884981013	YUM! BRANDS INC	4'306	980	934	4'352 USD	138.42	602'403.84	0.08	a)
US9892071054	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	891	0	0	891 USD	279.48	249'016.68	0.03	a)
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	3'652	0	1'736	1'916 USD	56.15	107'583.40	0.01	a)
US98956P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2'816	1'000	1'157	2'659 USD	124.36	330'673.24	0.04	a)
US98978V1035	ZOETIS INC	7'255	878	744	7'389 USD	198.33	1'465'460.37	0.20	a)
US98980F1049	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	2'767	0	2'767	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980G1022	ZSCALER INC	937	1'547	881	1'603 USD	241.97	387'877.91	0.05	a)
US98980L1017	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3'008	3'215	1'822	4'401 USD	70.73	311'282.73	0.04	a)
USFHB9032084	MARRIOTT INTERNATIONAL INC - FRACTIONAL SHS	22'313	0	0	22'313 USD	0.00	0.00	0.00	a)
US							712'601'492.04	96.71	

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Futures

0.00 0.00

03/23	S&P500 EMINI FUT MAR23	29	1	30	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P500 EMINI FUT JUN23	0	93	93	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P500 EMINI FUT SEP23	0	114	114	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	0	108	108	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	134	108	26 USD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

CHF/USD	Verfall	06.07.2023	334'713	300'000	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	06.09.2023	200'000	226'241	CHF/USD	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall	03.11.2023	14'418	20'000	USD/CAD	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF	Verfall	04.04.2023	16'838'253	18'030'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.04.2023	18'030'000	16'470'044	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.05.2023	17'046'451	18'720'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.05.2023	18'720'000	16'660'426	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.06.2023	17'152'839	19'340'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.06.2023	115'885	130'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	02.06.2023	19'470'000	17'797'138	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.07.2023	19'228'000	17'200'984	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	05.07.2023	17'764'577	19'510'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	05.07.2023	200'000	181'161	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	05.07.2023	82'000	73'314	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.08.2023	17'990'228	20'170'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.08.2023	20'170'000	17'483'558	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.09.2023	21'662'000	19'133'828	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	05.09.2023	18'710'184	21'662'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	03.10.2023	18'502'747	21'012'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.10.2023	155'000	136'625	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	03.10.2023	20'857'000	19'081'026	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.11.2023	17'462'260	19'149'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	02.11.2023	19'149'000	17'427'505	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.12.2023	16'979'321	18'720'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.12.2023	121'000	109'802	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.12.2023	170'000	152'371	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.12.2023	398'000	348'108	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.12.2023	18'031'000	15'678'135	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.01.2024	17'576'312	20'287'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	04.01.2024	126'068	145'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.01.2024	1'139'000	977'693	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	04.01.2024	19'293'000	16'237'182	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	02.02.2024	17'596'515	20'973'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	02.02.2024	110'000	93'511	USD/CHF	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	02.02.2024	5'390'000	4'692'992	USD/CHF	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 29.02.2024	Kurs 8)	Kurswert USD	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		293'520	340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		15'813'000	13'565'815		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		13'491'553	15'780'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		83'318	97'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		15'877'000	13'981'127		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		13'925'985	15'866'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert USD	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'754'568.39	0.78
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	730'284'321.10	99.11
Sonstige Vermögenswerte	804'039.10	0.11
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	736'842'928.59	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-32'729.73	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	736'810'198.86	

Bewertungskategorien	Kurswert USD	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);	730'284'321.10	99.11
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a) verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

CAD	1 = USD	0.73727283
CHF	1 = USD	1.13565385
EUR	1 = USD	1.08214568
GBP	1 = USD	1.26495000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	22'440'249.31	3.046
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	USD	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FA USD	USD	0.00 - 0.03	-	0.010	0.00 - 0.03	-	0.010
GT USD	USD	0.00 - 0.03	-	0.010	0.00 - 0.03	-	0.010
NT CHF	USD	0.00 - 0.03	-	0.010	0.00 - 0.03	-	0.010
NT USD	USD	0.00 - 0.03	-	0.010	0.00 - 0.03	-	0.010
NTH1 CHF	USD	0.00 - 0.03	-	0.010	0.00 - 0.03	-	0.010

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	USD	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	USD	-
Andere Wertpapiere	USD	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	USD	-

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: 01.03.2023 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FA USD	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
GT USD	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
NT USD	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

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

8 Benchmark

MSCI USA Index TR Net

9 TER

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

10 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA USD	Ja	USD	2.05000	0.71750	1.33250

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 18.06.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 21.06.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
GT USD	Ja	USD	1.772	0.620	1.152
NT CHF	Ja	USD	2.182	0.763	1.419
NT USD	Ja	USD	4.425	1.548	2.877
NTH1 CHF	Ja	USD	1.816	0.635	1.181

12 Fussnoten

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

13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

Anteilstklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilstklassen 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 Anteilstklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilstklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich wenn (i) für die verschiedenen Anteilstklassen 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 Anteilstklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilstklasse oder im Interesse mehrerer Anteilstklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

14 Pflichtpublikationen

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

Swisscanto (CH) Index Fund V

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

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 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 CHF) Govt. hedged CHF
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
(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zwei Teilvermögen des Umbrella-Fonds miteinander zu vereinigen und den Fondsvertrag gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil 1 dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

In Teil 2 dieser Veröffentlichung werden zusätzlichen Fondsvertragsänderungen, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweisen, erläutert. Dabei sollen folgende Anpassungen vorgenommen werden:

- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll künftig als Zielfonds von einer anderen kollektiven Kapitalanlage der Swisscanto Fondsleitung AG dienen (vgl. Teil 2, Ziff. 1 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll in diesem Zusammenhang daher ebenfalls repositioniert werden (vgl. Teil 2, Ziff. 2 dieser Veröffentlichung)
- Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll umbenannt und der Referenzindex soll gleichzeitig angepasst werden (vgl. Teil 2, Ziff. 3 dieser Veröffentlichung)
- Vereinigungen von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (siehe dazu die Ausführungen unter Teil 2, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil 1 – Vereinigung von Teilvermögen

I Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzung der Vereinigung

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 folgende Vereinigung des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds mit dem übernehmenden Teilvermögen des Umbrella-Fonds durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen	Übernehmendes Teilvermögen	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	25. Juli 2023

2 Begründung für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Transparenz erhöht und im Interesse der Anlegerinnen und Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 des Fondsvertrages geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die Zulässigkeit der geplanten Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist in § 25 des Fondsvertrages des Umbrella-Fonds vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Der Fondsvertrag der zu vereinigenden Teilvermögen stimmt nach der Durchführung der in Bst. II. dieser Veröffentlichung beantragten Änderungen des Fondsvertrages 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.
- Die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen werden auf den gleichen Tag bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus der Vereinigung Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Bst. II dieser Veröffentlichung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages wird mit Wirkung per 25. Juli 2023 das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anlegerinnen und Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Teilvermögens. Die Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich der Anteilsklasse des übernehmenden Teilvermögens, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Im Rahmen der Vereinigung werden die Anteile der Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übertragenden Teilvermögens in Anteile der neu zu eröffnenden Klassen FA CHF, GT CHF und NT CHF des übernehmenden Teilvermögens bei der Vereinigung per 25. Juli 2023 umgetauscht. Zudem werden per 25. Juli 2023 Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Massnahme	Datum des Umtausches oder der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)		
FA CHF	FA CHF	Umtausch	25. Juli 2023
DT CHF	FA CHF	Vereinigung	25. Juli 2023
GT CHF	GT CHF	Umtausch	25. Juli 2023
NT CHF	NT CHF	Umtausch	25. Juli 2023

Am Mittwoch, 26. Juli 2023, wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse per Dienstag, 25. Juli 2023, durchgeführt. Am Mittwoch, 26. Juli 2023 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf das übernehmende Teilvermögen rückwirkend auf Dienstag, 25. Juli 2023 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 22. März 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

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

7 Kosten

Dem übertragenden Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschiebung der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)	Letzter Cut Off (bis 14.00 Uhr)	20. Juli 2023
	Geschlossen (kein Cut Off von/bis)	21. Juli 2023 bis 26. Juli 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung der Teilvermögen

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

II Änderungen im Fondsvertrag

Im Hinblick auf die Vereinigung erfolgt in der Anlagepolitik eine Angleichung der teilvermögensspezifischen Bestimmungen des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens.

In § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrags wird neu ausgeführt, dass das übertragende Teilvermögen grundsätzlich den Referenzindex FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF nach bildet. Bis anhin war der FTSE Non-CHF World Government Bond Index der massgebende Referenzindex.

Teil 2 – Repositionierungen bei Teilvermögen, Umbenennung der Bezeichnung bei einem Teilvermögen und Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

1 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. soll neu als Zielfonds für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF (neu beantragte Bezeichnung Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I), vgl. nachstehende Ziff. 3 dieser Veröffentlichung) dienen. Diesbezüglich werden in § 8 Ziff. 21, § 15 Ziff. 13 und 22 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages verschiedene Hinweise aufgenommen.

Vor diesem Hintergrund wird in § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) hedged CHF neu vorgesehen, dass die Fondsleitung für das Vermögen des Teilvermögens bis zu 100% der Anteile des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. erwerben darf.

Die oben aufgeführte investierende kollektive Kapitalanlage, für welche das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. als Zielfonds fungiert, soll gemäss ihren Risikoverteilungsvorschriften jeweils bis zu 100% der Anteile des Zielfonds erwerben können (vgl. dazu die erwähnte Anpassung von § 15 Ziff. 13 des Fondsvertrages).

Erfolgt ein Antrag auf Rückgabe eines im Verhältnis zum Vermögen des Zielfonds grossen Teils der Anteile durch die massgebliche investierende kollektive Kapitalanlage, ist die Fondsleitung verpflichtet zu prüfen, ob diese Rückgabe ohne jeglichen Nachteil für die verbleibenden Anlegerinnen und Anleger abgewickelt werden kann. Erst dann lässt sie die betreffende Rückgabe zu. Ist die Rückgabe ohne Nachteile nicht gewährleistet, wird diese nicht zugelassen. Die Rücknahme durch den Zielfonds wird unverzüglich eingestellt und der betroffene Zielfonds wird fristlos aufgelöst. Die Rückzahlung wird dann im Rahmen des Auflösungsverfahrens vorgenommen. Ein entsprechender Hinweis wird in § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages aufgenommen.

2 Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF als investierende kollektive Kapitalanlage

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF soll neu in den Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren können. In diesem Zusammenhang wird neu ausgeführt, dass das Teilvermögen höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien des Zielfonds Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. investieren darf (vgl. die Anpassungen in § 8 Ziff. 21 sowie § 8 Ziff. 26 des Fondsvertrages).

Betreffend die weiteren für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF aufgenommenen Anpassungen in § 15 Ziff. 13, § 15 Ziff. 22 und § 26 Ziff. 1, welche zum Ziel haben, dass das Teilvermögen in den Zielfonds investieren kann, wird auf die obenstehenden Ausführungen in Ziff. 1 dieser Veröffentlichung verwiesen.

In § 15 Ziff. 12 des Fondsvertrages wird zudem eine neue Bestimmung aufgenommen, wonach die Fondsleitung für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF höchstens 40% des Vermögens in Anteile bzw. Aktien desselben Zielfonds angelegt werden darf.

3 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF sowie entsprechende Anpassung in der Anlagepolitik

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, § 8 Ziff. 23 und 27 (nach Vereinigung neue Ziff. 26), § 15 Ziff. 3, 13 und 22, § 21 Ziff. 1 sowie § 26 Ziff. 1 des Fondsvertrages)

Gleichzeitig mit der Anpassung der Bezeichnung des Teilvermögens wird auch der Referenzindex entsprechend in § 8 Ziff. 26 des angepassten Fondsvertrages angepasst. Der bisherige Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index, Currency-Hedged in CHF. Der neue Referenzindex ist der FTSE Non-CHF World Government Bond Index.

4 Vereinigung von Anteilsklassen und Löschung von bestehenden Anteilsklassen

4.1 Vereinigung von Anteilsklassen

Per 25. Juli 2023 werden Anteile der Klasse DT CHF des übertragenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FA CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt (vgl. unsere Ausführungen in Teil 1, I, Ziff. 4 dieser Veröffentlichung).

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
(übertragendes Teilvermögen)	(übernehmendes Teilvermögen)	
DT CHF	FA CHF	25. Juli 2023

Im Nachgang zur Vereinigung der Teilvermögen werden per 10. August 2023 die Anteile der Klasse DTH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens mit den Anteilen der Klasse FAH1 CHF des übernehmenden Teilvermögens vereinigt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF	Datum der Vereinigung
FAH1 CHF	DTH1 CHF	10. August 2023

Die jeweilige übertragende Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens wird gemäss der vorstehenden Tabelle, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, mit der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse des jeweiligen Teilvermögens vereinigt. Das Umtauschverhältnis für den Umtausch von Anteilen der jeweiligen übertragenden Anteilsklasse in Anteile der jeweiligen übernehmenden Anteilsklasse wird jeweils nach Durchführung der Vereinigung im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds (www.fundinfo.com) veröffentlicht.

4.2 Löschung von bestehenden Anteilsklassen

Für das nachgenannte Teilvermögen sind die folgenden Anteilsklassen im angepassten Fondsvertrag nicht mehr vorgesehen (vgl. die Anpassungen in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrages):

Teilvermögen	Anteilsklassen
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	DT, DT CHF, DT EUR, DT GBP, DT USD, DTH1 EUR, DTH1 GBP, DTH1 USD

* * *

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

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

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

Zürich, 24. Mai 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

betreffend

Einstellung von Zeichnungen und Aufschub von Rückzahlungen von Anteilen des folgenden Teilvermögens des oben genannten Umbrella-Fonds

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

Das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) investiert einen wesentlichen Anteil seines Fondsvermögens in neun 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.) des Umbrella-Fonds *Swisscanto (CH) Index Fund II*, bei welchen im Rahmen der Vereinigung mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt. des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während einzelner Tage Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden (vgl. die Publikation vom 18. September 2023 betreffend den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund II und den Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V).

Dies hat zur Folge, dass beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds Swisscanto (CH) Index Fund V während des folgenden Zeitraums Zeichnungen eingestellt und Rückzahlungen aufgeschoben werden:

Teilvermögen	Zeitraum Einstellung der Ausgabe von Anteilen bzw. des Aufschubes von Rückzahlungen (geschlossen, kein Cut-off von/bis)
Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)	20. November 2023 bis 24. November 2023

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

Zürich, 14. November 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich