

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

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 CHF	56317036	CHF
GT USD	55176721	USD
NA CHF	115989480	CHF
NT CHF	45146175	CHF
NTH1 CHF	52089277	CHF

Rechnungswährung: CHF

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 beigegefügte 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	33
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	34
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	34
7	Pauschale Verwaltungskommission	35
8	Benchmark	35
9	TER	35
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	36
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	36
12	Fussnoten	36
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	37
14	Pflichtpublikationen	39

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					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'180'749'113.24	641'132'374.13	657'216'154.41	408'607'923.01
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		17'597'594.87	11'003'381.65	6'244'740.97	163'845.78
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		133'297.769	96'496.457	51'373.131	1'502.202
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		132.0172	114.0289	121.5566	109.0704
Ausschüttung je Anteil		-	1.80	1.40	0.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.25 %	0.25 %	0.27 %	0.33 %
Klasse GT USD					
	USD				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		64'892'439.61	39'656'575.66	28'681'690.88	17'527'646.39
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		467'665.890	334'362.736	228'718.000	156'038.600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		157.5812	126.5441	136.6854	124.0792
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		138.7581	118.6035	125.4020	112.3289
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		0.09	1.78	1.58	0.82
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.22 %	0.22 %	0.22 %	0.22 %
Klasse NA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		226'440'609.42			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'025'336.049			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		111.8040			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		126.9706			
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %			
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		562'423'102.76	498'741'464.73	545'525'757.86	334'976'746.25
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'445'541.743	3'579'891.040	3'708'342.309	2'542'895.769
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		163.2321	139.3175	147.1077	131.7304
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		185.3752	148.6450	160.3441	145.5102
Thesaurierung je Anteil		0.42	2.40	2.19	1.75
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		309'395'366.58	91'730'952.09	76'763'964.70	55'939'684.59
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'192'002.401	780'071.459	603'974.683	487'934.600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		141.1474	117.5930	127.0980	114.6459
Thesaurierung je Anteil		0.37	2.02	1.89	1.52
Total Expense Ratio (Synthetische 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 CHF	17.57 %	13.18 %	-17.13 %	25.38 %
Klasse GT USD	25.16 %	24.44 %	-18.37 %	21.74 %
Klasse NA CHF (Lancierung 19.09.2023)	11.80 %	1.06 %	-	-
Klasse NT CHF	17.85 %	13.45 %	-16.93 %	25.76 %
Klasse NTH1 CHF	20.71 %	19.28 %	-18.15 %	22.86 %
Benchmark Hedge	20.62 %	18.56 %	-18.11 %	-
Benchmark	17.80 %	12.82 %	-16.87 %	25.65 %
Tracking Error 33)	0.36 %	0.56 %	0.48 %	0.47 %

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 CHF (Lancierung 02.09.2020)	-0.23 %
Klasse GT USD (Lancierung 18.06.2020)	7.36 %
Klasse NA CHF (Lancierung 19.09.2023)	-6.00 %
Klasse NT CHF	0.05 %
Klasse NTH1 CHF	0.09 %

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	5'296'160.06	13'782'565.85
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	72'748'996.79	626'647'206.00
Bezugsrechte	0.00	6'537.29
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'105'073'929.18	0.00
Sonstige Vermögenswerte	309'093.78	783'403.44
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'183'428'179.81	641'219'712.58
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-2'566'508.84	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-112'557.73	-87'338.45
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'180'749'113.24	641'132'374.13

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		96'496.457	51'373.131
Ausgegebene Anteile		55'397.269	60'998.166
Zurückgenommene Anteile		-18'595.957	-15'874.840
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		133'297.769	96'496.457
Klasse GT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		334'362.736	228'718.000
Ausgegebene Anteile		206'304.052	169'822.551
Zurückgenommene Anteile		-73'000.898	-64'177.815
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		467'665.890	334'362.736
Klasse NA CHF			
		<i>Lancierung</i> 19.09.2023	
Ausgegebene Anteile		2'025'436.049	
Zurückgenommene Anteile		-100.000	
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'025'336.049	
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'579'891.040	3'708'342.309
Ausgegebene Anteile		869'297.703	817'993.156
Zurückgenommene Anteile		-1'003'647.000	-946'444.425
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'445'541.743	3'579'891.040
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		780'071.459	603'974.683
Ausgegebene Anteile		1'556'632.750	288'781.851
Zurückgenommene Anteile		-144'701.808	-112'685.075
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'192'002.401	780'071.459

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		641'132'374.13	657'216'154.41
Ausbezahlte Ausschüttung		-186'995.44	-111'123.06
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-4'005'492.43	-3'286'840.02
Saldo aus dem Anteilverkehr		373'846'051.31	16'019'911.94
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		169'963'175.67	-28'705'729.14
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'180'749'113.24	641'132'374.13

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2023 29.02.2024	01.03.2022 28.02.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		280'829.47	43'755.64
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-2'829.58	-7'209.23
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		2'055'171.92	10'314'061.17
Erträge der Gratisaktien		85'667.07	276'663.97
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		640'779.14	1'745'082.90
Total Ertrag		3'059'618.02	12'372'354.45
Aufwand			
Passivzinsen		-188.85	-32.34
Reglementarische Vergütungen		-141'537.20	-90'345.68
Sonstige Aufwendungen		-49.96	-867.84
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-380'329.12	-1'317'460.39
Total Aufwand		-522'105.13	-1'408'706.25
Nettoertrag / Verlust		2'537'512.89	10'963'648.20
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		33'547'754.21	1'560'291.45
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		148'226.34	278'966.41
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		472'512.39	146'933.51
Realisierter Erfolg		36'706'005.83	12'949'839.57
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		133'257'169.84	-41'655'568.71
Gesamterfolg		169'963'175.67	-28'705'729.14

Verwendung des Erfolges

Klasse FA CHF		29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag		8'499.20	169'714.04
Vortrag des Vorjahres		3'427.75	7'407.33
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		11'926.95	177'121.37
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		0.00	173'693.62
Vortrag auf neue Rechnung		11'926.95	3'427.75
Total		11'926.95	177'121.37
Klasse GT USD		29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag		43'484.18	598'140.01
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		43'484.18	598'140.01
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		15'219.46	209'349.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		28'264.72	388'791.01
Total		43'484.18	598'140.01
Klasse NA CHF		29.02.2024	
Nettoertrag		198'403.71	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		198'403.71	
Vortrag auf neue Rechnung		198'403.71	
Total		198'403.71	
Klasse NT CHF		29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag		1'472'153.51	8'616'384.59
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		1'472'153.51	8'616'384.59
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		515'253.73	3'015'734.61
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		956'899.78	5'600'649.98
Total		1'472'153.51	8'616'384.59
Klasse NTH1 CHF		29.02.2024	28.02.2023
Nettoertrag		814'972.29	1'579'409.56
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		814'972.29	1'579'409.56
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		285'240.30	552'793.35
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		529'731.99	1'026'616.21
Total		814'972.29	1'579'409.56

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 CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							72'748'996.79	6.15	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							72'748'996.79	6.15	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	837	0	837	0 USD	0.00	0.00	0.00	
AR							0.00	0.00	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	5'658	0	5'658	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT0000746409	VERBUND AG	1'879	0	1'879	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
AT							0.00	0.00	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	10'487	5'373	1'679	14'181 AUD	46.63	379'146.75	0.03	a)
AU000000ANZ3	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	55'353	41'927	32'821	64'459 AUD	28.45	1'051'479.72	0.09	a)
AU000000APA1	APA GROUP	18'824	9'501	15'531	12'794 AUD	7.85	57'585.22	0.00	a)
AU000000AZJ1	AURIZON HOLDINGS LTD	938	16'166	10'000	7'104 AUD	3.81	15'518.97	0.00	a)
AU000000BHP4	BHP GROUP LTD	73'553	0	73'553	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000BSL0	BLUESCOPE STEEL LTD	9'708	14'942	10'587	14'063 AUD	22.84	184'165.87	0.02	a)
AU000000BXB1	BRAMBLES LTD	27'052	39'904	15'741	51'215 AUD	15.07	442'532.83	0.04	a)
AU000000CAR3	CAR GROUP LTD	0	6'588	0	6'588 AUD	36.76	138'855.84	0.01	a)
AU000000CBA7	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	22'957	21'523	852	43'628 AUD	116.41	2'911'995.22	0.25	a)
AU000000CPU5	COMPUTERSHARE LTD	9'850	12'285	4'247	17'888 AUD	25.92	265'847.05	0.02	a)
AU000000CSL8	CSL LTD	7'206	5'729	305	12'630 AUD	286.24	2'072'854.12	0.18	a)
AU000000DXS1	DEXUS/AU	24'543	6'551	11'796	19'298 AUD	7.36	81'437.64	0.01	a)
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	28'826	56'147	12'590	72'383 AUD	25.93	1'076'153.35	0.09	a)
AU000000GMG2	GOODMAN GROUP	20'879	23'014	4'759	39'134 AUD	29.90	670'904.17	0.06	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	9'472	13'649	9'431	13'690 AUD	4.35	34'145.05	0.00	a)
AU000000IEL5	IDP EDUCATION LTD	0	5'942	909	5'033 AUD	19.09	55'089.38	0.00	a)
AU000000IGO4	IGO LTD	25'900	43'100	69'000	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000LLC3	LENLEASE GROUP	10'860	0	10'860	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000MGR9	MIRVAC GROUP	68'669	90'179	90'916	67'932 AUD	2.18	84'911.39	0.01	a)
AU000000MIN4	MINERAL RESOURCES LTD	3'872	5'798	1'139	8'531 AUD	66.69	326'208.84	0.03	a)
AU000000MQG1	MACQUARIE GROUP LTD	6'847	6'599	3'574	9'872 AUD	194.81	1'102'684.98	0.09	a)
AU000000NAB4	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	46'800	39'273	8'559	77'514 AUD	33.84	1'503'992.14	0.13	a)
AU000000NCM7	NEWCREST MINING LTD	24'432	8'724	33'156	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000NST8	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	0	71'485	21'667	49'818 AUD	12.90	368'477.58	0.03	a)
AU000000ORG5	ORIGIN ENERGY LTD	13'993	23'700	0	37'693 AUD	8.99	194'292.24	0.02	a)
AU000000ORI1	ORICA LTD	0	39'808	546	39'262 AUD	17.11	385'174.47	0.03	a)
AU000000PLS0	PILBARA MINERALS LTD	0	190'349	0	190'349 AUD	4.20	458'389.81	0.04	a)
AU000000QAN2	QANTAS AIRWAYS LTD	577	8'850	9'427	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000REA9	REA GROUP LTD	0	977	0	977 AUD	194.11	108'737.05	0.01	a)
AU000000RHC8	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5'690	11'763	12'408	5'045 AUD	54.91	158'835.54	0.01	a)
AU000000S320	SOUTH32 LTD	33'218	203'371	54'026	182'563 AUD	2.95	308'794.70	0.03	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	47'329	0	34'487	12'842 AUD	3.11	22'899.61	0.00	a)
AU000000SEK6	SEEK LTD	0	2'596	1'658	938 AUD	26.23	14'107.05	0.00	a)
AU000000SGP0	STOCKLAND	35'950	15'079	0	51'029 AUD	4.49	131'370.68	0.01	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	0	14'074	0	14'074 AUD	29.85	240'877.89	0.02	a)
AU000000TCL6	TRANSURBAN GROUP	39'291	46'953	0	86'244 AUD	13.54	669'549.39	0.06	a)
AU000000TLS2	TELSTRA GROUP LTD	56'758	101'151	0	157'909 AUD	3.82	345'863.96	0.03	a)
AU000000TWE9	TREASURY WINE ESTATES LTD	14'153	2'584	1'838	14'899 AUD	12.35	105'501.62	0.01	a)
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	49'975	0	0	49'975 AUD	1.94	55'589.09	0.00	a)
AU000000WBC1	WESTPAC BANKING CORP	59'758	32'970	18'378	74'350 AUD	26.35	1'123'302.32	0.09	a)
AU000000WES1	WESFARMERS LTD	15'664	15'983	3'875	27'772 AUD	66.64	1'061'151.05	0.09	a)
AU000000WOW2	WOOLWORTHS GROUP LTD	17'212	35'872	1'248	51'836 AUD	32.62	969'506.00	0.08	a)
AU000000WTC3	WISETECH GLOBAL LTD	1'982	1'388	0	3'370 AUD	94.48	182'559.67	0.02	a)
AU0000030678	COLES GROUP LTD	22'846	13'790	36'636	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000088338	AMPOL LTD	10'174	9'201	6'185	13'190 AUD	39.40	297'972.43	0.03	a)
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	0	12'071	0	12'071 AUD	5.50	38'066.33	0.00	a)
AU0000219529	LOTTERY CORP LTD/THE	0	84'331	8'818	75'513 AUD	5.08	219'948.25	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 CHF	in % 7)	Kat.
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	28'892	22'416	1'194	50'114 AUD	30.36	872'360.31	0.07	a)
AU							20'788'835.57	1.76	
BE0003470755	SOLVAY SA	1'006	0	1'006	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003565737	KBC GROUP NV	4'167	0	4'167	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003739530	UCB SA	3'888	0	3'888	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974259880	D'IETEREN GROUP	782	0	782	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	11'265	0	11'265	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974320526	UMICORE	6'831	0	6'831	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE							0.00	0.00	
BMG0450A1053	ARCH CAPITAL GROUP LTD	8'819	0	8'819	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	1'339	0	1'339	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BM							0.00	0.00	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	26'293	16'616	42'909	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0084741085	AGNICO EAGLE MINES LTD	0	12'845	0	12'845 CAD	65.09	542'788.49	0.05	a)
CA0089118776	AIR CANADA	452	4'997	3'322	2'127 CAD	18.12	25'021.19	0.00	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	317	6'877	7'194	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	12'713	10'538	2'790	20'461 CAD	84.17	1'118'063.41	0.09	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	5'024	7'652	1'397	11'279 CAD	29.09	213'008.32	0.02	a)
CA05534B7604	BCE INC	161	5'907	6'068	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA05577W2004	BRP INC/CA- SUB VOTING	690	0	690	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	10'754	7'762	2'881	15'635 CAD	122.84	1'246'866.46	0.11	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	17'732	10'796	0	28'528 CAD	65.81	1'218'836.54	0.10	a)
CA0679011084	BARRICK GOLD CORP	29'003	9'522	38'525	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA11271J1075	BROOKFIELD CORP	22'668	14'238	1'161	35'745 CAD	56.00	1'299'527.81	0.11	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	5'411	4'860	10'271	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1247651088	CAE INC	10'688	0	10'688	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA12532H1047	CGI INC	4'503	1'169	5'672	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA13321L1085	CAMECO CORP	10'129	10'813	20'942	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1349211054	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1'192	0	0	1'192 CAD	47.61	36'843.14	0.00	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	14'887	12'049	0	26'936 CAD	64.22	1'123'015.25	0.09	a)
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	8'653	6'275	5'160	9'768 CAD	175.97	1'115'903.23	0.09	a)
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	15'415	9'700	3'637	21'478 CAD	94.54	1'318'231.50	0.11	a)
CA13645T1003	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13'497	1'969	15'466	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA13646K1084	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	0	26'701	4'833	21'868 CAD	115.23	1'635'900.47	0.14	a)
CA1366812024	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1'514	574	1'142	946 CAD	138.10	84'813.91	0.01	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	1'334	6'217	7'551	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA15135U1093	CENOVUS ENERGY INC	0	59'314	14'632	44'682 CAD	23.65	686'034.57	0.06	a)
CA21037X1006	CONSTELLATION SOFTWARE INC	0	786	91	695 CAD	3'778.39	1'704'801.58	0.14	a)
CA2499061083	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	4'092	241	4'333	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA2908761018	EMERA INC	0	1'180	829	351 CAD	47.60	10'846.67	0.00	a)
CA2918434077	EMPIRE CO LTD 'A'	3'334	1'913	5'247	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	34'245	37'106	0	71'351 CAD	46.65	2'160'896.48	0.18	a)
CA3359341052	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	6'935	1'277	3'447	4'765 CAD	12.85	39'751.02	0.00	a)
CA33767E2024	FIRSTSERVICE CORP	866	920	178	1'608 CAD	223.34	233'149.67	0.02	a)
CA3495531079	FORTIS INC	60	4'631	2'677	2'014 CAD	52.33	68'421.48	0.01	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	4'453	3'775	1'702	6'526 CAD	142.09	601'994.93	0.05	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	2'702	2'160	0	4'862 CAD	47.26	149'173.24	0.01	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	20'112	12'908	5'744	27'276 CAD	40.45	716'277.75	0.06	a)
CA4495861060	IGM FINANCIAL INC	10'820	653	11'473	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4530384086	IMPERIAL OIL LTD	0	9'221	520	8'701 CAD	84.92	479'690.82	0.04	a)
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	13'891	6'168	14'988	5'071 CAD	14.43	47'505.31	0.00	a)
CA4932711001	KEYERA CORP	5'989	18'608	24'597	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	33'753	16'537	0	50'290 CAD	6.64	216'786.37	0.02	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	5'725	583	5'142 CAD	144.64	482'839.44	0.04	a)
CA5503721063	LUNDIN MINING CORP	398	12'172	6'365	6'205 CAD	10.73	43'223.88	0.00	a)
CA5527041084	MEG ENERGY CORP	0	19'680	1'552	18'128 CAD	29.05	341'883.61	0.03	a)
CA5592224011	MAGNA INTERNATIONAL INC	2'657	2'883	0	5'540 CAD	74.78	268'953.67	0.02	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	78'416	78'416	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA59162N1096	METRO INC/CN	5'361	6'945	12'306	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	0	15'992	1'011	14'981 CAD	105.93	1'030'248.59	0.09	a)
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	4'073	0	3'812	261 CAD	23.00	3'897.18	0.00	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 CHF	in % 7)	Kat.
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	8'149	3'082	3'122	8'109 CAD	70.84	372'930.67	0.03	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	494	0	494	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	7'586	0	7'586	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6979001089	PAN AMERICAN SILVER CORP	7'452	10'276	2'111	15'617 CAD	16.84	170'734.76	0.01	a)
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	10'085	998	11'083	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	0	26'729	1'208	25'521 CAD	39.21	649'646.02	0.05	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	8'888	8'888	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	6'935	8'925	1'835	14'025 CAD	105.38	959'496.32	0.08	a)
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1'415	0	458	957 CAD	17.88	11'108.66	0.00	a)
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	6'982	4'262	0	11'244 CAD	60.06	438'418.04	0.04	a)
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	22'779	16'911	3'799	35'891 CAD	131.80	3'071'024.07	0.26	a)
CA8029121057	SAPUTO INC	6'930	1'897	8'827	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA82028K2002	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	9'208	0	9'208	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA82509L1076	SHOPIFY INC - CLASS A	15'132	14'445	601	28'976 CAD	103.69	1'950'552.11	0.16	a)
CA85472N1096	STANTEC INC	0	5'151	366	4'785 CAD	113.32	352'022.77	0.03	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	11'735	16'480	2'660	25'555 CAD	72.08	1'195'839.55	0.10	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	23'927	17'791	6'375	35'343 CAD	46.63	1'069'919.44	0.09	a)
CA87807B1076	TC ENERGY CORP	5'375	10'310	1'049	14'636 CAD	53.68	510'055.18	0.04	a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	7'931	2'165	0	10'096 CAD	52.15	341'810.90	0.03	a)
CA87971M9969	TELUS CORP-W/I	2'657	6'287	0	8'944 CAD	23.63	137'207.47	0.01	a)
CA8849038085	THOMSON REUTERS CORP	0	7'988	687	7'301 CAD	214.24	1'015'465.47	0.09	a)
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	29'214	19'213	8'640	39'787 CAD	81.49	2'104'882.04	0.18	a)
CA92938W2022	WSP GLOBAL INC	3'685	3'190	1'185	5'690 CAD	215.42	795'757.13	0.07	a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1'122	1'539	362	2'299 CAD	109.22	163'013.43	0.01	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	0	2'828	707	2'121 CAD	177.76	244'769.31	0.02	a)
CA9628791027	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	0	18'499	0	18'499 CAD	55.93	671'699.96	0.06	a)
US5500211090	LULULEMON ATHLETICA INC	1'977	0	1'977	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CA							36'491'549.28	3.08	
CH0044328745	CHUBB LTD	8'475	0	8'475	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0114405324	GARMIN LTD	3'702	0	3'702	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	7'289	0	7'289	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	16'841	0	16'841	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
CH							0.00	0.00	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	42'837	0	42'837	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6'321	0	6'321	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2'147	0	2'147	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005313704	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1'459	0	1'459	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005552004	DHL GROUP	18'499	0	18'499	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	62'911	0	62'911	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	9'337	0	9'337	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	3'210	0	3'210	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006047004	HEIDELBERG MATERIALS AG	207	0	207	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006062144	COVESTRO AG	6'556	0	6'556	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	3'311	0	3'311	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	14'203	0	14'203	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	16'400	0	16'400	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	11'071	0	11'071	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	6'747	0	6'747	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2'926	0	2'926	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES AG	1'881	0	1'881	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A12DM80	SCOUT24 SE	1'767	0	1'767	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1DAH0	BRENNTAG SE	2'874	0	2'874	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	2'830	0	2'830	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1ML7J1	VONOVIA SE	10'986	0	10'986	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	36'098	0	36'098	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000DTROCK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	9'442	0	9'442	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	17'701	0	17'701	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	18'771	0	18'771	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	1'031	0	1'031	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	2'138	0	2'138	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	1'912	0	1'912	0 EUR	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 CHF	in % 7)	Kat.
DE000SHL1006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	7'883	0	7'883	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000SYM9999	SYMRISE AG	3'824	0	3'824	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	4'737	0	4'737	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE							0.00	0.00	
DK0010181759	CARLSBERG AS-B	1'711	0	1'711	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0010219153	ROCKWOOL A/S-B SHS	44	0	44	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0010274414	DANSKE BANK A/S	12'993	0	12'993	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060079531	DSV A/S	3'051	0	3'051	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060094928	ORSTED A/S	3'134	0	3'134	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060227585	CHR HANSEN HOLDING A/S	2'712	0	2'712	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060252690	PANDORA A/S	1'797	0	1'797	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060448595	COLOPLAST-B	2'155	0	2'155	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	23'715	0	23'715	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18'471	0	18'471	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK							0.00	0.00	
ES0105046009	AENA SME SA	1'871	0	1'871	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0105563003	CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	3'774	0	3'774	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	8'198	0	8'198	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	282'218	0	282'218	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0116870314	NATURGY ENERGY GROUP SA	1'918	0	1'918	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0118900010	FERROVIAL SA	13'803	0	13'803	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	12'764	0	12'764	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0130670112	ENDESA SA	9'183	0	9'183	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0130960018	ENAGAS SA	15'157	0	15'157	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	85'098	0	85'098	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	17'238	0	17'238	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050915	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9'388	0	9'388	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	9'601	0	9'601	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES							0.00	0.00	
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	4'063	0	4'063	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009000681	NOKIA OYJ	83'080	0	83'080	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	3'524	0	3'524	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	13'736	0	13'736	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	9'214	0	9'214	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009007132	FORTUM OYJ	8'265	0	8'265	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009007884	ELISA OYJ	1'675	0	1'675	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009013296	NESTE OYJ	7'999	0	7'999	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009013403	KONE OYJ-B	4'094	0	4'094	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	3'254	0	3'254	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	55'521	0	55'521	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
FI							0.00	0.00	
FR0000039299	BOLLORE SE	27'365	0	27'365	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	5'591	0	5'591	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120172	CARREFOUR SA	6'899	0	6'899	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	41'435	0	41'435	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120321	L'OREAL	3'447	0	3'447	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120404	ACCOR SA	5'624	0	5'624	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120503	BOUYGUES SA	2'773	0	2'773	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120578	SANOFI	18'107	0	18'107	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120628	AXA SA	27'667	0	27'667	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120644	DANONE	6'765	0	6'765	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	3'755	0	3'755	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3'491	0	3'491	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121121	EURAZEO SE	831	0	831	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121204	WENDEL	735	0	735	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121220	SODEXO SA	3'324	0	3'324	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121485	KERING	1'039	0	1'039	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	4'925	0	4'925	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121709	SEB SA	397	0	397	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121964	KLEPIERRE	4'013	0	4'013	0 EUR	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 CHF	in % 7)	Kat.
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	7'859	0	7'859	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	4'636	0	4'636	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7'365	0	7'365	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000125338	CAPGEMINI SE	3'039	0	3'039	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000125486	VINCI SA	8'634	0	8'634	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000127771	VIVENDI SE	10'610	0	10'610	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130395	REMY COINTREAU	541	0	541	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130452	EIFFAGE	504	0	504	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	4'520	0	4'520	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	15'000	0	15'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	17'124	0	17'124	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131906	RENAULT SA	4'998	0	4'998	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000133308	ORANGE	32'863	0	32'863	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0004125920	AMUNDI SA	187	0	187	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0006174348	BUREAU VERITAS SA	5'275	0	5'275	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010040865	GECINA SA	687	0	687	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010208488	ENGIE	26'504	0	26'504	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010220475	ALSTOM	4'310	0	4'310	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010307819	LEGRAND SA	4'933	0	4'933	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010313833	ARKEMA	2'532	0	2'532	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010340141	ADP	671	0	671	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010533075	GETLINK SE	9'602	0	9'602	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010908533	EDENRED	4'224	0	4'224	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0011981968	WORLDLINE SA	4'701	0	4'701	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013154002	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	880	0	880	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	2'117	0	2'117	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013280286	BIOMERIEUX	1'020	0	1'020	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2'243	0	2'243	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	266	0	266	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	10'901	0	10'901	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	8'309	0	8'309	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR							0.00	0.00	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	0	21'713	836	20'877 AUD	123.78	1'481'677.32	0.13	a)
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	18'164	0	18'164	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0000536739	ASHTREAD GROUP PLC	5'050	0	5'050	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	19'755	0	19'755	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0001367019	BRITISH LAND CO PLC	15'661	0	15'661	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0002374006	DIAGEO PLC	37'417	0	37'417	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0004052071	HALMA PLC	8'576	0	8'576	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	45'865	0	45'865	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	278'772	0	278'772	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	107'883	0	107'883	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0006731235	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	5'791	0	5'791	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0006776081	PEARSON PLC	15'670	0	15'670	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0006825383	PERSIMMON PLC	8'222	0	8'222	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	32'882	0	32'882	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007669376	ST JAMES'S PLACE PLC	5'929	0	5'929	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007908733	SSE PLC	17'025	0	17'025	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007980591	BP PLC	320'137	0	320'137	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	54'337	0	54'337	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	22'651	0	22'651	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0030913577	BT GROUP PLC	108'175	0	108'175	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031348658	BARCLAYS PLC	214'116	0	214'116	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	1'726	0	1'726	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	5'887	0	5'887	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0032089863	NEXT PLC	445	0	445	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0033195214	KINGFISHER PLC	29'425	0	29'425	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	52'847	0	52'847	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B0744B38	BUNZL PLC	8'829	0	8'829	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B05WJX34	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4'451	0	4'451	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	40'904	0	40'904	0 GBP	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 CHF	in % 7)	Kat.
GB00B1KJJ408	WHITBREAD PLC	1'103	0	1'103	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1VZ0M25	HARGREAVES LANSDOWN PLC	4'163	0	4'163	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	8'049	0	8'049	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1XZ5820	ANGLO AMERICAN PLC	26'939	0	26'939	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1YW4409	3I GROUP PLC	16'495	0	16'495	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	11'310	0	11'310	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B2B0DG97	RELX PLC	29'621	0	29'621	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B5Z1N188	SEGRO PLC	22'509	0	22'509	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B63H8491	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	127'639	0	127'639	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B8W67662	LIBERTY GLOBAL PLC-A	16'098	0	16'098	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00B8W67B19	LIBERTY GLOBAL PLC- C	2'277	0	2'277	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	32'202	0	32'202	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4'861	0	4'861	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	51'624	0	51'624	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BF8Q6K64	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	63'448	0	63'448	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BH4HK539	VODAFONE GROUP PLC	428'257	0	428'257	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BHJYC057	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	1'104	0	1'104	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BJFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	3'951	0	3'951	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKFB1C65	M&G PLC	52'433	0	52'433	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	154'748	0	154'748	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	127'692	0	127'692	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	32'702	0	32'702	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BN7SWP63	GSK PLC	66'292	0	66'292	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BNR5MZ78	MELROSE INDUSTRIES PLC	30'574	0	30'574	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	109'468	0	109'468	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BP9LHF23	SCHRODERS PLC	5'497	0	5'497	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	51'638	0	51'638	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	12'304	0	12'304	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BWFQGN14	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1'304	0	1'304	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	13'183	0	13'183	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BZ4BQC70	JOHNSON MATTHEY PLC	5'247	0	5'247	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE00BLP1HW54	AON PLC-CLASS A	3'080	0	3'080	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	1'023	0	1'023	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BZ12WP82	LINDE PLC	0	7'576	7'576	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00B783TY65	APTIV PLC	5'058	0	5'058	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00B8KF9B49	WPP PLC	10'259	0	10'259	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
JE00BJ1F3079	AMCOR PLC	32'303	0	32'303	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJJN4441	CLARIVATE PLC	11'173	0	11'173	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00BJVNS543	FERGUSON PLC	2'002	0	2'002	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	14'804	0	14'804	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
GB							1'481'677.32	0.13	
BMG2178K1009	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	500	25'000	0	25'500 HKD	46.05	132'077.44	0.01 a)	
BMG4587L1090	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	0	50'700	0	50'700 USD	3.38	150'896.33	0.01 a)	
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	57'800	0	4'200	53'600 HKD	16.16	97'423.78	0.01 a)	
HK0000069689	AIA GROUP LTD	183'400	138'200	47'200	274'400 HKD	63.60	1'962'908.44	0.17 a)	
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	0	36'000	0	36'000 HKD	9.55	38'669.16	0.00 a)	
HK0000608585	NEW WORLD DEVELOPMENT	16'500	50'000	66'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	428'800	314'000	123'000	619'800 HKD	6.06	422'457.49	0.04 a)	
HK0004000045	WHARF HOLDINGS LTD	0	14'000	0	14'000 HKD	28.95	45'586.41	0.00 a)	
HK0006000050	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	7'000	6'500	4'500	9'000 HKD	47.10	47'678.46	0.00 a)	
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	0	29'800	0	29'800 HKD	89.40	299'648.84	0.03 a)	
HK0012000102	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	0	14'000	0	14'000 HKD	22.60	35'587.32	0.00 a)	
HK0016000132	SUN HUNG KAI PROPERTIES	0	6'500	0	6'500 HKD	78.95	57'719.73	0.00 a)	
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	6'000	20'000	5'500	20'500 HKD	64.90	149'643.33	0.01 a)	
HK0027032686	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	14'000	21'000	35'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0066009694	MTR CORP	58'000	20'427	3'500	74'927 HKD	26.00	219'114.19	0.02 a)	
HK0083000502	SINO LAND CO	136'000	226'047	90'000	272'047 HKD	8.45	258'558.89	0.02 a)	
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	0	27'000	0	27'000 HKD	8.46	25'691.71	0.00 a)	
HK0388045442	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	20'200	18'600	4'400	34'400 HKD	242.80	939'433.29	0.08 a)	
HK0669013440	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	20'500	16'000	6'500	30'000 HKD	84.75	285'969.54	0.02 a)	
HK0823032773	LINK REIT	36'500	10'300	46'800	0 HKD	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 CHF	in % 7)	Kat.
KYG1674K1013	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	0	20'700	20'700	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG217651051	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	55'500	19'500	0	75'000 HKD	39.75	335'318.27	0.03	a)
KYG217781014	CK ASSET HOLDINGS LTD	43'500	44'500	13'000	75'000 HKD	36.15	304'949.82	0.03	a)
KYG319891092	ESR GROUP LTD	0	30'200	0	30'200 HKD	10.46	35'530.18	0.00	a)
KYG8187G1055	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	0	24'000	0	24'000 HKD	12.88	34'768.50	0.00	a)
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	31'000	26'000	15'000	42'000 HKD	26.15	123'532.09	0.01	a)
HK							6'003'163.21	0.51	
AU000000JHX1	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	0	19'602	6'466	13'136 AUD	60.75	457'556.24	0.04	a)
CRH ID	CRH PLC	7'853	0	7'853	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	3'049	0	3'049	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
GB00B19NLV48	EXPERIAN PLC	13'857	0	13'857	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE0002424939	DCC PLC	1'375	0	1'375	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	1'904	0	1'904	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	1'222	0	1'222	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	5'986	0	5'986	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	10'546	0	10'546	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	20'511	0	20'511	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	27'668	0	27'668	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IE00BFRT3W74	ALLEGION PLC	413	0	413	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BK9ZQ967	TRANE TECHNOLOGIES PLC	4'328	0	4'328	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	18'249	0	18'249	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE							457'556.24	0.04	
IL0002300114	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	11'502	20'085	31'587	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0002730112	NICE LTD	1'169	720	0	1'889 ILS	87'670.00	408'295.11	0.03	a)
IL0002810146	ICL GROUP LTD	2'515	13'409	5'329	10'595 ILS	1'889.00	49'342.84	0.00	a)
IL0006046119	BANK LEUMI LE-ISRAEL	23'741	12'615	36'356	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006625771	BANK HAPOLIM BM	25'190	25'958	0	51'148 ILS	3'418.00	431'014.55	0.04	a)
IL0006912120	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	15'282	15'952	31'234	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006954379	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1'960	7'361	0	9'321 ILS	14'130.00	324'710.16	0.03	a)
IL0010823792	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	713	230	943	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	0	1'559	0	1'559 USD	160.42	220'220.96	0.02	a)
IL0011194789	AZRIELI GROUP LTD	297	546	843	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0011334468	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1'924	248	325	1'847 USD	263.76	428'972.89	0.04	a)
IL0011741688	GLOBAL-E ONLINE LTD	0	1'032	0	1'032 USD	33.87	30'778.60	0.00	a)
IL0011762130	MONDAY.COM LTD	0	1'578	600	978 USD	223.01	192'051.28	0.02	a)
US8816242098	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20'056	9'533	0	29'589 USD	13.15	342'617.91	0.03	a)
IL							2'428'004.30	0.21	
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	9'916	0	9'916	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IM							0.00	0.00	
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	11'504	0	11'504	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	5'320	0	5'320	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	236'703	0	236'703	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003128367	ENEL SPA	102'482	0	102'482	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003153415	SNAM SPA	23'062	0	23'062	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	45'955	0	45'955	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	181'128	0	181'128	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003828271	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	2'917	0	2'917	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	6'672	0	6'672	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0004965148	MONCLER SPA	5'528	0	5'528	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0005239360	UNICREDIT SPA	33'528	0	33'528	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011585146	FERRARI NV	2'000	0	2'000	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015435975	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	7'420	0	7'420	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
IT							0.00	0.00	
GB00B0LCW083	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2'540	0	2'540	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
JO							0.00	0.00	
JP3027670003	NIPPON BUILDING FUND INC	8	0	8	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3027680002	JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT	9	0	9	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3039710003	JAPAN METROPOLITAN FUND INVE	288	0	288	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3047550003	NIPPON PROLOGIS REIT INC	29	0	29	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3048110005	NOMURA REAL ESTATE MASTER FU	84	0	84	0 JPY	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP3102000001	AISIN CORP	3'700	0	3'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3104890003	TIS INC	5'200	0	5'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3111200006	ASAHI KASEI CORP	26'600	0	26'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3112000009	AGC INC	1'500	0	1'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3116000005	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	6'500	0	6'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3119600009	AJINOMOTO CO INC	6'700	0	6'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3122400009	ADVANTEST CORP	4'200	0	4'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3137200006	ISUZU MOTORS LTD	17'400	0	17'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3142500002	IDEMITSU KOSAN CO LTD	7'000	0	7'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3143600009	ITOCHU CORP	22'700	0	22'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3143900003	ITOCHU TECHNO-SOLUTIONS CORP	5'300	0	5'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3160400002	EISAI CO LTD	4'300	0	4'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3162770006	SG HOLDINGS CO LTD	9'500	0	9'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164630000	SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD	2'200	0	2'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164720009	RENESAS ELECTRONICS CORP	20'900	0	20'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	4'300	0	4'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165700000	NTT DATA GROUP CORP	7'400	0	7'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3174410005	OJI HOLDINGS CORP	18'100	0	18'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3180400008	OSAKA GAS CO LTD	5'500	0	5'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3190000004	OBAYASHI CORP	21'200	0	21'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	6'900	0	6'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197800000	OMRON CORP	5'300	0	5'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3198900007	ORIENTAL LAND CO LTD	3'200	0	3'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	19'200	0	19'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3201200007	OLYMPUS CORP	20'200	0	20'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3205800000	KAO CORP	8'400	0	8'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3210200006	KAJIMA CORP	7'900	0	7'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3218900003	CAPCOM CO LTD	4'800	0	4'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3228600007	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	5'500	0	5'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3236200006	KEYENCE CORP	2'500	0	2'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3240400006	KIKKOMAN CORP	2'000	0	2'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3242800005	CANON INC	15'100	0	15'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3249600002	KYOCERA CORP	4'900	0	4'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3256000005	KYOWA KIRIN CO LTD	7'200	0	7'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3258000003	KIRIN HOLDINGS CO LTD	10'400	0	10'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3260800002	KINTETSU GROUP HOLDINGS CO L	2'400	0	2'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3266400005	KUBOTA CORP	18'700	0	18'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3270000007	KURITA WATER INDUSTRIES LTD	3'600	0	3'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3294460005	INPEX CORP	9'900	0	9'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3304200003	KOMATSU LTD	17'300	0	17'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3311400000	CYBERAGENT INC	14'400	0	14'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3322930003	SUMCO CORP	5'000	0	5'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3347200002	SHIONOGI & CO LTD	5'000	0	5'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3351100007	SYSMEX CORP	3'200	0	3'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3351600006	SHISEIDO CO LTD	6'400	0	6'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3358800005	SHIMIZU CORP	22'700	0	22'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3359600008	SHARP CORP	9'300	0	9'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3360800001	HULIC CO LTD	15'700	0	15'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3362700001	MITSUI OSK LINES LTD	200	0	200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3371200001	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	4'800	0	4'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3381000003	NIPPON STEEL CORP	3'200	0	3'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3385890003	GMO PAYMENT GATEWAY INC	1'500	0	1'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3386030005	JFE HOLDINGS INC	13'300	0	13'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3388200002	AEON CO LTD	10'500	0	10'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3400400002	SCSK CORP	3'800	0	3'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	11'100	0	11'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3402600005	SUMITOMO METAL MINING CO LTD	5'700	0	5'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3407400005	SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES	14'600	0	14'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	7'400	0	7'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3420600003	SEKISUI HOUSE LTD	9'900	0	9'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3421800008	SECOM CO LTD	3'500	0	3'500	0 JPY	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP3422950000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	10'800	0	10'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3429800000	ANA HOLDINGS INC	1'600	0	1'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3435000009	SONY GROUP CORP	17'300	0	17'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3436100006	SOFTBANK GROUP CORP	16'200	0	16'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3443600006	TAISEI CORP	4'700	0	4'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3463000004	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	21'200	0	21'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3475350009	DAIICHI SANKYO CO LTD	24'800	0	24'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3476480003	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	15'900	0	15'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3481800005	DAIKIN INDUSTRIES LTD	3'000	0	3'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3486800000	DAITO TRUST CONSTRUCT CO LTD	800	0	800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3496400007	KDDI CORP	26'500	0	26'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3497400006	DAIFUKU CO LTD	2'400	0	2'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3499800005	MITSUBISHI HC CAPITAL INC	33'200	0	33'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3500610005	RESONA HOLDINGS INC	72'100	0	72'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3502200003	DAIWA SECURITIES GROUP INC	37'900	0	37'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3505000004	DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD	8'400	0	8'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3519400000	CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD	13'000	0	13'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3539220008	T&D HOLDINGS INC	9'400	0	9'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3546800008	TERUMO CORP	8'500	0	8'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3551520004	DENTSU GROUP INC	4'400	0	4'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3566800003	CENTRAL JAPAN RAILWAY CO	2'600	0	2'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	2'500	0	2'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	10'400	0	10'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3574200006	TOKYU CORP	9'400	0	9'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3592200004	TOSHIBA CORP	6'500	0	6'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3595200001	TOSOH CORP	2'100	0	2'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3596200000	TOTO LTD	3'300	0	3'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3626800001	LIXIL CORP	6'200	0	6'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	145'965	0	145'965	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3634600005	TOYOTA INDUSTRIES CORP	100	0	100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3635000007	TOYOTA TSUSHO CORP	1'600	0	1'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3637300009	TREND MICRO INC	2'900	0	2'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3639650005	PAN PACIFIC INTERNATIONAL HO	9'000	0	9'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3670800006	NISSAN CHEMICAL CORP	4'300	0	4'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3672400003	NISSAN MOTOR CO LTD	51'600	0	51'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3675600005	NISSIN FOODS HOLDINGS CO LTD	1'600	0	1'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	4'100	0	4'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3688370000	NIPPON EXPRESS HOLDINGS INC	2'200	0	2'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3695200000	NGK INSULATORS LTD	4'300	0	4'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3726800000	JAPAN TOBACCO INC	18'500	0	18'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3733000008	NEC CORP	4'000	0	4'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3734800000	NIDEC CORP	8'400	0	8'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	20'400	0	20'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3753000003	NIPPON YUSEN KK	7'300	0	7'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3756600007	NINTENDO CO LTD	16'000	0	16'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762600009	NOMURA HOLDINGS INC	69'300	0	69'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762800005	NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT	6'700	0	6'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3766550002	HAKUHODO DY HOLDINGS INC	7'800	0	7'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3774200004	HANKYU HANSHIN HOLDINGS INC	3'200	0	3'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3778630008	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	3'800	0	3'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3783600004	EAST JAPAN RAILWAY CO	5'700	0	5'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3787000003	HITACHI CONSTRUCTION MACHINE	4'400	0	4'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	13'800	0	13'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3802300008	FAST RETAILING CO LTD	2'700	0	2'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3802400006	FANUC CORP	3'100	0	3'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3814000000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	5'200	0	5'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3818000006	FUJITSU LIMITED	2'900	0	2'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	10'000	0	10'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3837800006	HOYA CORP	5'500	0	5'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	25'700	0	25'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3868400007	MAZDA MOTOR CORP	17'900	0	17'900	0 JPY	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 CHF	in % 7)	Kat.
JP3888300005	MITSUI CHEMICALS INC	4'600	0	4'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	6'800	0	6'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	23'100	0	23'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3892100003	SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDIN	6'400	0	6'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3893200000	MITSUI FUDOSAN CO LTD	14'300	0	14'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3893600001	MITSUI & CO LTD	25'200	0	25'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3898400001	MITSUBISHI CORP	15'000	0	15'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3899600005	MITSUBISHI ESTATE CO LTD	19'000	0	19'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3902400005	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	36'900	0	36'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3902900004	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	166'900	0	166'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3906000009	MINEBEA MITSUMI INC	8'600	0	8'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	27'600	0	27'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3914400001	MURATA MANUFACTURING CO LTD	8'700	0	8'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3918000005	MEIJI HOLDINGS CO LTD	2'600	0	2'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3932000007	YASKAWA ELECTRIC CORP	8'100	0	8'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3933800009	LY CORP	50'900	0	50'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3940000007	YAMATO HOLDINGS CO LTD	6'900	0	6'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942600002	YAMAHA CORP	4'200	0	4'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3944130008	USS CO LTD	6'700	0	6'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3951600000	UNICHARM CORP	7'300	0	7'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3955000009	YOKOGAWA ELECTRIC CORP	7'700	0	7'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3967200001	RAKUTEN GROUP INC	29'100	0	29'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3970300004	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	20'400	0	20'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3973400009	RICOH CO LTD	12'800	0	12'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3982800009	ROHM CO LTD	1'200	0	1'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP							0.00	0.00	
US81141R1005	SEA LTD-ADR	7'664	8'623	16'287	0 USD	0.00	0.00	0.00	
KY							0.00	0.00	
LU1598757687	ARCELORMITTAL	5'133	0	5'133	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
LU							0.00	0.00	
KYG7800X1079	SANDS CHINA LTD	35'200	43'600	19'600	59'200 HKD	22.30	148'485.96	0.01 a)	
MO							148'485.96	0.01	
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	3'321	0	3'321	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	57'266	0	57'266	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000009165	HEINEKEN NV	5'240	0	5'240	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	11'611	0	11'611	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	3'352	0	3'352	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000303709	AEGON NV	39'658	0	39'658	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000379121	RANDSTAD NV	1'156	0	1'156	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	4'299	0	4'299	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0006294274	EURONEXT NV	460	0	460	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	5'106	0	5'106	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0010273215	ASML HOLDING NV	5'850	0	5'850	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0010558797	OCI NV	1'936	0	1'936	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0010801007	IMCD NV	1'306	0	1'306	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	13'147	0	13'147	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011821202	ING GROEP NV	56'307	0	56'307	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	2'361	0	2'361	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0013654783	PROSUS NV	12'218	0	12'218	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0014332678	JDE PEET'S NV	1'050	0	1'050	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150001Q9	STELLANTIS NV	40'639	0	40'639	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL							0.00	0.00	
NO0003054108	MOWI ASA	10'702	0	10'702	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0003733800	ORKLA ASA	18'133	0	18'133	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0005052605	NORSK HYDRO ASA	36'459	0	36'459	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010063308	TELENOR ASA	18'703	0	18'703	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010161896	DNB BANK ASA	22'533	0	22'533	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	2'516	0	2'516	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010310956	SALMAR ASA	1'713	0	1'713	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO0010582521	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10'096	0	10'096	0 NOK	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 CHF	in % 7)	Kat.
NO0010844038	ADEVINTA ASA-B	3'676	0	3'676	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO							0.00	0.00	
NZAIAE000256	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	16'453	25'087	11'638	29'902 NZD	8.10	129'937.59	0.01	a)
NZFAPE000152	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	0	13'936	13'936	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
NZMELE000257	MERIDIAN ENERGY LTD	23'980	43'377	7'173	60'184 NZD	5.98	193'077.56	0.02	a)
NZMRPE000152	MERCURY NZ LTD	20'483	27'982	15'967	32'498 NZD	6.68	116'461.57	0.01	a)
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	37'629	58'860	9'017	87'472 NZD	5.07	237'917.60	0.02	a)
NZXROE000152	XERO LTD	2'360	586	0	2'946 AUD	127.31	215'045.48	0.02	a)
NZ							892'439.80	0.08	
PTEDPOAM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	41'618	0	41'618	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PTJMTOAE0001	JERONIMO MARTINS	4'821	0	4'821	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
PT							0.00	0.00	
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	10'116	0	10'116	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000108227	SKF AB-B SHARES	8'042	0	8'042	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	51'678	0	51'678	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000112724	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	17'704	0	17'704	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000113250	SKANSKA AB-B SHS	7'258	0	7'258	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	5'880	0	5'880	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	22'862	0	22'862	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000202624	GETINGE AB-B SHS	8'228	0	8'228	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000242455	SWEDBANK AB - A SHARES	15'943	0	15'943	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000667891	SANDVIK AB	19'109	0	19'109	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000667925	TELIA CO AB	40'874	0	40'874	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000695876	ALFA LAVAL AB	4'657	0	4'657	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	10'715	0	10'715	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	14'905	0	14'905	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0012853455	EQT AB	5'641	0	5'641	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015658109	EPIROC AB-A	12'500	0	12'500	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015658117	EPIROC AB-B	6'279	0	6'279	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015810247	KINNEVIK AB - B	4'998	0	4'998	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015811955	INVESTOR AB-A SHS	4'302	0	4'302	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015811963	INVESTOR AB-B SHS	39'737	0	39'737	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	29'389	0	29'389	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0016589188	ELECTROLUX AB-B	4'741	0	4'741	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0016844831	VOLVO CAR AB-B	16'453	0	16'453	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0017486889	ATLAS COPCO AB-A SHS	21'627	0	21'627	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0017486897	ATLAS COPCO AB-B SHS	27'155	0	27'155	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0017768716	BOLIDEN AB	10'425	0	10'425	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE							0.00	0.00	
SG1H97877952	SEBACORP MARINE LTD	771'035	1'443'700	476'000	1'738'735 SGD	0.09	102'479.46	0.01	a)
SG1J26887955	SINGAPORE EXCHANGE LTD	0	39'700	0	39'700 SGD	9.45	245'687.59	0.02	a)
SG1L01001701	DBS GROUP HOLDINGS LTD	40'400	41'600	2'800	79'200 SGD	33.33	1'728'707.06	0.15	a)
SG1M51904654	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	132'318	98'600	0	230'918 SGD	1.96	296'397.66	0.03	a)
SG1M77906915	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	56'000	153'400	209'400	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1R50925390	SEBACORP INDUSTRIES LTD	0	10'200	0	10'200 SGD	5.10	34'066.79	0.00	a)
SG1R89002252	CITY DEVELOPMENTS LTD	12'600	27'000	4'200	35'400 SGD	5.67	131'445.96	0.01	a)
SG1S03926213	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	0	158'800	9'800	149'000 SGD	1.48	144'413.87	0.01	a)
SG1S83002349	UOL GROUP LTD	25'000	14'600	39'600	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1T22929874	KEPPEL REIT	0	12'520	12'520	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1T56930848	WILMAR INTERNATIONAL LTD	56'700	43'700	41'700	58'700 SGD	3.32	127'625.39	0.01	a)
SG1T75931496	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	117'400	265'700	7'200	375'900 SGD	2.35	578'496.98	0.05	a)
SG1U68934629	KEPPEL LTD	40'400	37'200	16'900	60'700 SGD	7.24	287'798.26	0.02	a)
SG1V61937297	SINGAPORE AIRLINES LTD	16'700	15'300	19'900	12'100 SGD	6.47	51'268.49	0.00	a)
SG2D18969584	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1'900	130'500	30'000	102'400 SGD	1.35	90'530.44	0.01	a)
SGXE21576413	GENTING SINGAPORE LTD	330'500	163'700	494'200	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SGXE62145532	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	0	123'400	10'600	112'800 SGD	2.78	205'359.50	0.02	a)
SG							4'024'277.45	0.34	
AN8068571086	SCHLUMBERGER LTD	30'391	0	30'391	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BMG169621056	BUNGE LTD	3'845	0	3'845	0 USD	0.00	0.00	0.00	
BMG491BT1088	INVESCO LTD	1'928	0	1'928	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 CHF	in % 7)	Kat.
CA11284V1058	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	0	1'578	0	1'578 CAD	32.22	33'007.66	0.00	a)
CA94106B1013	WASTE CONNECTIONS INC	899	0	899	0 USD	0.00	0.00	0.00	
GB00BFBMBMT84	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1'044	0	1'044	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	9'658	0	9'658	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BFY8C754	STERIS PLC	2'293	0	2'293	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9'657	0	9'657	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	3'339	0	3'339	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A	5'959	0	5'959	0 USD	0.00	0.00	0.00	
PA1436583006	CARNIVAL CORP	20'468	0	20'468	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0010551028	AFLAC INC	10'811	0	10'811	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	115'196	0	115'196	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	23'246	0	23'246	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00287Y1091	ABBVIE INC	29'534	0	29'534	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00724F1012	ADOBE INC	8'493	0	8'493	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	25'591	0	25'591	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00846U1016	AGILENT TECHNOLOGIES INC	7'958	0	7'958	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0091581068	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1'698	0	1'698	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0126531013	ALBEMARLE CORP	2'579	0	2'579	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0138721065	ALCOA CORP	1'153	0	1'153	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0152711091	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3'888	0	3'888	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	5'990	0	5'990	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	9'810	0	9'810	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	74'315	0	74'315	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	82'441	0	82'441	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02209S1033	ALTRIA GROUP INC	29'702	0	29'702	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0231351067	AMAZON.COM INC	123'954	0	123'954	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0255371017	AMERICAN ELECTRIC POWER	495	0	495	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	9'179	0	9'179	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0259321042	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2'526	0	2'526	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02665T3068	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	14'772	0	14'772	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	7'123	0	7'123	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0304201033	AMERICAN WATER WORKS CO INC	4'600	0	4'600	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	4'807	0	4'807	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03076C1062	AMERIPRISE FINANCIAL INC	3'070	0	3'070	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0311001004	AMETEK INC	332	0	332	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0326541051	ANALOG DEVICES INC	11'263	0	11'263	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0357108390	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9'283	0	9'283	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	4'394	0	4'394	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ANTHEM INC	4'210	0	4'210	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03743Q1085	APA CORP	8'500	0	8'500	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03769M1062	APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	6'287	0	6'287	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0378331005	APPLE INC	218'430	0	218'430	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	15'751	0	15'751	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	11'127	0	11'127	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US03990B1017	ARES MANAGEMENT CORP - A	602	0	602	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US04621X1081	ASSURANT INC	1'070	0	1'070	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	6'012	0	6'012	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0530151036	AUTOMATIC DATA PROCESSING	8'296	0	8'296	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0534841012	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3'245	0	3'245	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05352A1007	AVANTOR INC	17'364	0	17'364	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	1'559	0	1'559	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US05722G1004	BAKER HUGHES A GE CO	21'221	0	21'221	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0584981064	BALL CORP	12'776	0	12'776	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	111'375	0	111'375	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	14'885	0	14'885	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	7'845	0	7'845	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0758871091	BECTON DICKINSON AND CO	4'779	0	4'779	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	4'573	0	4'573	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0905722072	BIO-RAD LABORATORIES-A	1'222	0	1'222	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09062X1037	BIOGEN INC	3'823	0	3'823	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09247X1019	BLACKROCK INC	2'353	0	2'353	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 CHF	in % 7)	Kat.
US09260D1072	BLACKSTONE INC	8'424	0	8'424	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	588	0	588	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0995021062	BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3'532	0	3'532	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011211018	BOSTON PROPERTIES INC	942	0	942	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1011371077	BOSTON SCIENTIFIC CORP	23'263	0	23'263	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	34'508	0	34'508	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	4'309	0	4'309	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1156372096	BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	650	0	650	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12503M1080	CBOE GLOBAL MARKETS INC	3'607	0	3'607	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	4'557	0	4'557	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1252691001	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2'707	0	2'707	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12541W2098	C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2'847	0	2'847	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	5'559	0	5'559	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US12572Q1058	CME GROUP INC	4'799	0	4'799	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1258961002	CMS ENERGY CORP	13'616	0	13'616	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1264081035	CSX CORP	44'562	0	44'562	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1266501006	CVS HEALTH CORP	19'572	0	19'572	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1331311027	CAMDEN PROPERTY TRUST	3'592	0	3'592	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	3'479	0	3'479	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1'566	0	1'566	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	7'813	0	7'813	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1423391002	CARLISLE COS INC	1'363	0	1'363	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14316J1088	CARLYLE GROUP INC/THE	1'609	0	1'609	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	14'153	0	14'153	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1488061029	CATALENT INC	5'506	0	5'506	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1491231015	CATERPILLAR INC	9'179	0	9'179	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US15189T1079	CENTERPOINT ENERGY INC	17'919	0	17'919	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1598641074	CHARLES RIVER LABORATORIES	1'961	0	1'961	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	8'726	0	8'726	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1651677353	CHESAPEAKE ENERGY CORP	459	0	459	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	22'089	0	22'089	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	490	0	490	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1720621010	CINCINNATI FINANCIAL CORP	3'949	0	3'949	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1729081059	CINTAS CORP	1'427	0	1'427	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1729674242	CITIGROUP INC	26'967	0	26'967	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1890541097	CLOROX COMPANY	2'900	0	2'900	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	69'922	0	69'922	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13'739	0	13'739	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US19260Q1076	COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	5'393	0	5'393	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	9'757	0	9'757	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	87'234	0	87'234	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	4'722	0	4'722	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	26'265	0	26'265	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	6'656	0	6'656	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US21037T1097	CONSTELLATION ENERGY	4'789	0	4'789	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22052L1044	CORTEVA INC	8'228	0	8'228	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	7'424	0	7'424	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22822V1017	CROWN CASTLE INC	6'567	0	6'567	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2310211063	CUMMINS INC	2'893	0	2'893	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2333311072	DTE ENERGY COMPANY	3'567	0	3'567	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2358511028	DANAHER CORP	11'321	0	11'321	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	3'591	0	3'591	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2372661015	DARLING INGREDIENTS INC	1'493	0	1'493	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US23918K1088	DAVITA INC	6'828	0	6'828	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2441991054	DEERE & CO	5'164	0	5'164	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2473617023	DELTA AIR LINES INC	11'364	0	11'364	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2538681030	DIGITAL REALTY TRUST INC	4'929	0	4'929	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	30'642	0	30'642	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2547091080	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6'613	0	6'613	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US25746U1097	DOMINION ENERGY INC	3'472	0	3'472	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2600031080	DOVER CORP	3'653	0	3'653	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 CHF	in % 7)	Kat.
US2605571031	DOW INC	11'150	0	11'150	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2774321002	EASTMAN CHEMICAL CO	867	0	867	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	10'505	0	10'505	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2788651006	ECOLAB INC	2'865	0	2'865	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2810201077	EDISON INTERNATIONAL	19'338	0	19'338	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17'339	0	17'339	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	4'999	0	4'999	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29355A1079	ENPHASE ENERGY INC	3'262	0	3'262	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29362U1043	ENTEGRIS INC	3'068	0	3'068	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29414B1044	EPAM SYSTEMS INC	1'585	0	1'585	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2944291051	EQUIFAX INC	1'366	0	1'366	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29444U7000	EQUINIX INC	1'640	0	1'640	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29452E1010	EQUITABLE HOLDINGS INC	10'988	0	10'988	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US29476L1070	EQUITY RESIDENTIAL	7'561	0	7'561	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2971781057	ESSEX PROPERTY TRUST INC	222	0	222	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30040W1080	EVERSOURCE ENERGY	21'208	0	21'208	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30161N1019	EXELON CORP	16'665	0	16'665	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	52'381	0	52'381	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3024913036	FMC CORP	4'220	0	4'220	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	32'340	0	32'340	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3030751057	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1'302	0	1'302	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3119001044	FASTENAL CO	903	0	903	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US31428X1063	FEDEX CORP	3'742	0	3'742	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	20'913	0	20'913	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3364331070	FIRST SOLAR INC	3'161	0	3'161	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3377381088	FISERV INC	15'111	0	15'111	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959E1091	FORTINET INC	22'240	0	22'240	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959J1088	FORTIVE CORP	694	0	694	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34964C1062	FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	820	0	820	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	16'392	0	16'392	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35137L2043	FOX CORP - CLASS B	10'740	0	10'740	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3546131018	FRANKLIN RESOURCES INC	4'476	0	4'476	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US35671D8570	FREEPORT-MCMORAN INC	23'597	0	23'597	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US36266G1076	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	8'187	0	8'187	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3687361044	GENERAC HOLDINGS INC	1'349	0	1'349	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	24'562	0	24'562	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	16'581	0	16'581	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3724601055	GENUINE PARTS CO	4'071	0	4'071	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	26'067	0	26'067	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US37959E1029	GLOBE LIFE INC	403	0	403	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US38141G1040	GOLDMAN SACHS GROUP INC	5'250	0	5'250	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3848021040	WW GRAINGER INC	1'697	0	1'697	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4062161017	HALLIBURTON CO	11'309	0	11'309	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	7'590	0	7'590	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4180561072	HASBRO INC	4'379	0	4'379	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42250P1030	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9'721	0	9'721	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4228061093	HEICO CORP	1'160	0	1'160	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4228062083	HEICO CORP-CLASS A	1'718	0	1'718	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4278661081	HERSHEY CO/THE	3'707	0	3'707	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42809H1077	HESS CORP	7'949	0	7'949	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	48'796	0	48'796	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4'821	0	4'821	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4364401012	HOLOGIC INC	4'038	0	4'038	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	14'056	0	14'056	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4404521001	HORMEL FOODS CORP	8'414	0	8'414	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	20'114	0	20'114	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4432011082	HOWMET AEROSPACE INC	43'588	0	43'588	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4435106079	HUBBELL INC	468	0	468	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4435731009	HUBSPOT INC	2'570	0	2'570	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	2'489	0	2'489	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4456581077	HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3'051	0	3'051	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 CHF	in % 7)	Kat.
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	38'637	0	38'637	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45167R1041	IDEX CORP	2'899	0	2'899	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45168D1046	IDEXX LABORATORIES INC	1'088	0	1'088	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523081093	ILLINOIS TOOL WORKS	5'921	0	5'921	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4523271090	ILLUMINA INC	3'502	0	3'502	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45687V1061	INGERSOLL-RAND INC	14'592	0	14'592	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	62'305	0	62'305	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45866F1049	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7'423	0	7'423	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	16'067	0	16'067	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4595061015	INTL FLAVORS & FRAGRANCES	6'004	0	6'004	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	1'287	0	1'287	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4612021034	INTUIT INC	6'121	0	6'121	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	5'339	0	5'339	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46266C1053	IQVIA HOLDINGS INC	4'047	0	4'047	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	5'694	0	5'694	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	38'407	0	38'407	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46982L1089	JACOBS SOLUTIONS INC	5'845	0	5'845	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	36'794	0	36'794	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US48251W1045	KKR & CO INC	3'718	0	3'718	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4878361082	KELLANOVA	6'323	0	6'323	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4932671088	KEYCORP	28'793	0	28'793	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	1'311	0	1'311	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49446R1095	KIMCO REALTY CORP	8'408	0	8'408	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5018892084	LKQ CORP	7'273	0	7'273	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US50212V1008	LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	1'815	0	1'815	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1'326	0	1'326	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	2'633	0	2'633	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	9'223	0	9'223	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5184391044	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3'497	0	3'497	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5218652049	LEAR CORP	2'611	0	2'611	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5261071071	LENNOX INTERNATIONAL INC	177	0	177	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5324571083	ELI LILLY & CO	11'934	0	11'934	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5486611073	LOWE'S COS INC	9'538	0	9'538	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US55354G1004	MSCI INC	325	0	325	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	21'020	0	21'020	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	7'481	0	7'481	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57060D1081	MARKETAXESS HOLDINGS INC	813	0	813	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	9'869	0	9'869	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5719032022	MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4'704	0	4'704	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5745991068	MASCO CORP	928	0	928	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	12'622	0	12'622	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5797802064	MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5'812	0	5'812	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5801351017	MCDONALD'S CORP	12'544	0	12'544	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	38'818	0	38'818	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US59156R1086	METLIFE INC	17'682	0	17'682	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5926881054	METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	553	0	553	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5949181045	MICROSOFT CORP	99'420	0	99'420	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	18'460	0	18'460	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	4'598	0	4'598	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6092071058	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	22'729	0	22'729	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60937P1066	MONGODB INC	3'044	0	3'044	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US61174X1090	MONSTER BEVERAGE CORP	5'196	0	5'196	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6153691059	MOODY'S CORP	2'718	0	2'718	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6174464486	MORGAN STANLEY	13'852	0	13'852	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	8'878	0	8'878	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US62944T1051	NVR INC	109	0	109	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6311031081	NASDAQ INC	12'477	0	12'477	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6512291062	NEWELL BRANDS INC	5'655	0	5'655	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6516391066	NEWMONT CORP	8'555	0	8'555	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US65339F1012	NEXTERA ENERGY INC	26'294	0	26'294	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6541061031	NIKE INC -CL B	18'551	0	18'551	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 CHF	in % 7)	Kat.
US65473P1057	NISOURCE INC	4'417	0	4'417	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6556631025	NORDSON CORP	1'194	0	1'194	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6658591044	NORTHERN TRUST CORP	5'565	0	5'565	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6687711084	NORTONLIFLOCK INC	33'007	0	33'007	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6703461052	NUCOR CORP	2'493	0	2'493	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US67066G1040	NVIDIA CORP	35'310	0	35'310	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6745991058	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	11'424	0	11'424	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6819191064	OMNICOM GROUP	12'219	0	12'219	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	10'767	0	10'767	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68902V1070	OTIS WORLDWIDE CORP	7'004	0	7'004	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	2'734	0	2'734	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69331C1080	P G & E CORP	39'511	0	39'511	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6'527	0	6'527	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	4'432	0	4'432	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US69351T1060	PPL CORP	1'617	0	1'617	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6937181088	PACCAR INC	2'392	0	2'392	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6951561090	PACKAGING CORP OF AMERICA	1'916	0	1'916	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	10'661	0	10'661	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7010941042	PARKER HANNIFIN CORP	1'278	0	1'278	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	19'048	0	19'048	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7134481081	PEPSICO INC	24'059	0	24'059	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7140461093	PERKINELMER INC	4'083	0	4'083	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7170811035	PFIZER INC	79'752	0	79'752	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7185461040	PHILLIPS 66	13'557	0	13'557	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7237871071	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	5'004	0	5'004	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72919P2020	PLUG POWER INC	14'536	0	14'536	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74144T1088	T ROWE PRICE GROUP INC	3'050	0	3'050	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74251V1026	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6'864	0	6'864	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	31'609	0	31'609	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7433151039	PROGRESSIVE CORP	11'095	0	11'095	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74340W1036	PROLOGIS INC	15'253	0	15'253	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14'615	0	14'615	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7445731067	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	11'182	0	11'182	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74460D1090	PUBLIC STORAGE	2'646	0	2'646	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7458671010	PULTEGROUP INC	15'303	0	15'303	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74736K1016	QORVO INC	3'818	0	3'818	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7475251036	QUALCOMM INC	17'762	0	17'762	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74762E1029	QUANTA SERVICES INC	2'649	0	2'649	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	2'385	0	2'385	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7496851038	RPM INTERNATIONAL INC	456	0	456	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7547301090	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2'126	0	2'126	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7561091049	REALTY INCOME CORP	12'918	0	12'918	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7588491032	REGENCY CENTERS CORP	4'247	0	4'247	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	2'168	0	2'168	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7607591002	REPUBLIC SERVICES INC	3'333	0	3'333	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7611521078	RESMED INC	3'254	0	3'254	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7703231032	ROBERT HALF INC	3'020	0	3'020	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7739031091	ROCKWELL AUTOMATION INC	4'146	0	4'146	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	4'922	0	4'922	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US78410G1040	SBA COMMUNICATIONS CORP	1'156	0	1'156	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7841171033	SEI INVESTMENTS COMPANY	756	0	756	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8085131055	SCHWAB (CHARLES) CORP	21'174	0	21'174	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US81211K1007	SEALED AIR CORP	904	0	904	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8168511090	SEMPRA	8'898	0	8'898	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8288061091	SIMON PROPERTY GROUP INC	1'768	0	1'768	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US83088M1027	SKYWORKS SOLUTIONS INC	3'547	0	3'547	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8318652091	SMITH (A.O.) CORP	764	0	764	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8326964058	JM SMUCKER CO/THE	1'253	0	1'253	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8330341012	SNAP-ON INC	195	0	195	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US83304A1060	SNAP INC - A	47'392	0	47'392	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8447411088	SOUTHWEST AIRLINES CO	1'205	0	1'205	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 CHF	in % 7)	Kat.
US8486371045	SPLUNK INC	7'535	0	7'535	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8522341036	BLOCK INC	12'353	0	12'353	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8545021011	STANLEY BLACK & DECKER INC	2'943	0	2'943	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8552441094	STARBUCKS CORP	16'555	0	16'555	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8574771031	STATE STREET CORP	8'621	0	8'621	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716071076	SYNOPSIS INC	4'475	0	4'475	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8716581035	SYNCHRONY FINANCIAL	13'397	0	13'397	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8725401090	TJX COMPANIES INC	22'460	0	22'460	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8740541094	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7'125	0	7'125	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US87612E1064	TARGET CORP	8'458	0	8'458	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88160R1014	TESLA INC	38'349	0	38'349	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8825081040	TEXAS INSTRUMENTS INC	15'759	0	15'759	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88579Y1010	3M CO	11'479	0	11'479	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	2'944	0	2'944	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8926721064	TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	813	0	813	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8936411003	TRANSDIGM GROUP INC	3'034	0	3'034	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89400J1079	TRANSUNION	1'658	0	1'658	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US89417E1091	TRAVELERS COS INC/THE	7'005	0	7'005	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9022521051	TYLER TECHNOLOGIES INC	3'119	0	3'119	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9024941034	TYSON FOODS INC-CL A	702	0	702	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9026531049	UDR INC	6'602	0	6'602	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9026811052	UGI CORP	7'852	0	7'852	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	30'112	0	30'112	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	11'182	0	11'182	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113121068	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9'936	0	9'936	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9113631090	UNITED RENTALS INC	1'920	0	1'920	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	13'148	0	13'148	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9182041080	VF CORP	5'502	0	5'502	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92276F1003	VENTAS INC	5'794	0	5'794	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	74'395	0	74'395	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	2'780	0	2'780	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92556H2067	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	20'480	0	20'480	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92556V1061	VIATRIS INC	19'851	0	19'851	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	24'953	0	24'953	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	8'581	0	8'581	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92939U1060	WEC ENERGY GROUP INC	479	0	479	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9297401088	WABTEC CORP	3'946	0	3'946	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9311421039	WALMART INC	24'009	0	24'009	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9314271084	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9'348	0	9'348	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	7'415	0	7'415	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9418481035	WATERS CORP	1'813	0	1'813	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	56'661	0	56'661	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US95040Q1040	WELLTOWER INC	7'796	0	7'796	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9553061055	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2'425	0	2'425	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9604131022	WESTLAKE CORP	444	0	444	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US96145D1054	WESTROCK CO	1'260	0	1'260	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9633201069	WHIRLPOOL CORP	1'142	0	1'142	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9694571004	WILLIAMS COS INC	32'139	0	32'139	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9778521024	WOLFSPEED INC	3'536	0	3'536	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	7'513	0	7'513	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9831341071	WYNN RESORTS LTD	2'420	0	2'420	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98389B1008	XCEL ENERGY INC	4'982	0	4'982	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98419M1009	XYLEM INC	4'590	0	4'590	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US9884981013	YUM! BRANDS INC	4'172	0	4'172	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98978V1035	ZOETIS INC	4'750	0	4'750	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98980L1017	ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	9'048	0	9'048	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US							33'007.66	0.00	
GB00B1CRLC47	MONDI PLC	11'756	0	11'756	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
ZA							0.00	0.00	
Bezugsrechte							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 CHF	in % 7)	Kat.
AU0000303125	TREASURY WINE ESTA-RIGHTS	0	1'601	1'601	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
CA21037X1428	CONSTELLATION SOFTWARE-RTS	0	486	486	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
G800BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	109'468	0	109'468	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
HK0000916640	LINK REIT -RIGHTS	7'300	0	7'300	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
Diverse							0.00	0.00	

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

							1'105'073'929.18	93.38	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							1'105'073'929.18	93.38	
CH1224004767	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE NT CHF	0	7'791'526	600'464	7'191'062 CHF	118.92	855'145'219.19	72.26	a)
CH1224025382	SWC (CH) IEF JAPAN RESPONSIBLE NT	0	962'707	63'868	898'840 JPY	14'294.48	75'591'016.40	6.39	a)
CH1224244819	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE NT CHF	0	1'544'436	122'173	1'422'264 CHF	122.58	174'337'693.59	14.73	a)
CH							1'105'073'929.18	93.38	

Nicht kotierte Wertpapiere

							0.00	0.00	
--	--	--	--	--	--	--	-------------	-------------	--

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte

							0.00	0.00	
G800B7FC0762	NMC HEALTH PLC	332	0	0	332 GBP	0.00	0.00	0.00	c)
AE							0.00	0.00	

Derivative Finanzinstrumente

							0.00	0.00	
--	--	--	--	--	--	--	-------------	-------------	--

Optionen und Optionsscheine

							0.00	0.00	
CA21037X1345	CONSTELLATION SOFTWARE --- WARRANT	0	486	0	486 CAD	0.00	0.00	0.00	a)

Futures

							0.00	0.00	
03/23	TOPIX INDX FUTR MAR23	4	0	4	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/23	SPI 200 FUTURES MAR23	2	3	5	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	21	10	31	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P500 EMINI FUT MAR23	30	15	45	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	FTSE 100 IDX FUT MAR23	5	0	5	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P/TSX 60 IX FUT MAR23	1	3	4	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
06/23	TOPIX INDX FUTR JUN23	0	20	20	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
06/23	SPI 200 FUTURES JUN23	0	14	14	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	116	116	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P500 EMINI FUT JUN23	0	155	155	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	25	25	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P/TSX 60 IX FUT JUN23	0	10	10	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	TOPIX INDX FUTR SEP23	0	11	11	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO STOXX 50 SEP23	0	51	51	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P500 EMINI FUT SEP23	0	75	75	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	FTSE 100 IDX FUT SEP23	0	11	11	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P/TSX 60 IX FUT SEP23	0	3	3	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SPI 200 FUTURES SEP23	0	7	7	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	TOPIX INDX FUTR DEC23	0	12	12	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	0	82	82	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	0	120	120	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	21	21	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	0	7	7	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	0	7	7	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	TOPIX INDX FUTR MAR24	0	22	20	2 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	118	107	11 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	164	148	16 USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	27	24	3 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	8	7	1 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	0	11	10	1 AUD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte			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 CHF	in % 7)	Kat.
USD/CAD	Verfall	04.04.2023		150'000	110'847	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall	18.04.2023		700'000	523'827	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	21.06.2023		1'966'536	2'200'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	21.06.2023		126'352	20'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	21.06.2023		88'075	130'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	21.06.2023		205'079	210'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	21.06.2023		80'165	70'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall	27.06.2023		350'000	40'092	HKD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	06.07.2023		146'610	150'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	06.07.2023		896'120	1'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall	21.07.2023		300'000	227'701	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall	19.09.2023		1'600'000	1'183'030	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall	21.09.2023		3'600'000	2'684'045	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/CAD	Verfall	31.10.2023		400'000	288'724	CAD/USD		0.00	0.00	
USD/ILS	Verfall	01.11.2023		550'000	135'658	ILS/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	17.01.2024		400'000	373'234	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	17.01.2024		1'000'000	850'910	USD/CHF		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte								0.00	0.00	

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF	Verfall	04.04.2023	64'108'637	68'646'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.04.2023	9'099'567	9'171'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	04.04.2023	222'030	2'456'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	04.04.2023	5'769'230	837'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall	04.04.2023	734'741	6'166'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall	04.04.2023	116'161	454'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	04.04.2023	2'094'073	3'321'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall	04.04.2023	335'340	483'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall	04.04.2023	809'974	6'074'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	04.04.2023	4'184'128	3'699'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall	04.04.2023	919'809	10'256'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	04.04.2023	3'216'083	4'687'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall	04.04.2023	56'701	98'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	04.04.2023	60'843	89'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	04.04.2023	1'034'311	1'103'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	04.04.2023	144'157	145'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	04.04.2023	94'258	13'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	04.04.2023	73'525	66'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	04.04.2023	43'413	70'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	04.04.2023	69'749'000	63'714'317	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall	04.04.2023	3'391'000	2'074'614	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall	04.04.2023	483'000	331'850	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall	04.04.2023	4'776'000	3'223'657	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	04.04.2023	851'300'000	5'842'983	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall	04.04.2023	2'456'000	214'212	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall	04.04.2023	454'000	115'180	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	04.04.2023	9'316'000	9'245'385	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall	04.04.2023	6'166'000	717'519	HKD/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall	04.04.2023	6'074'000	809'239	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall	04.04.2023	3'765'000	4'253'095	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall	04.04.2023	98'000	56'009	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall	04.04.2023	10'256'000	903'451	SEK/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	03.05.2023	2'088'524	3'421'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	03.05.2023	65'650'690	72'096'000	CHF/USD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall	03.05.2023	337'942	493'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	03.05.2023	3'220'139	4'784'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	03.05.2023	6'049'175	880'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	03.05.2023	225'222	2'587'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall	03.05.2023	118'165	467'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.05.2023	9'407'747	9'494'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall	03.05.2023	754'221	6'492'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall	03.05.2023	880'571	6'618'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	03.05.2023	4'146'569	3'680'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall	03.05.2023	57'544	101'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall	03.05.2023	910'458	10'352'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	03.05.2023	24'132	36'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	03.05.2023	262'666	291'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	03.05.2023	23'667	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	03.05.2023	20'089	2'903'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	03.05.2023	19'116	17'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	03.05.2023	883'203'000	5'772'615	JPY/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SGD Verfall 03.05.2023		493'000	328'870	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.05.2023		6'618'000	872'517	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.05.2023		4'820'000	3'162'788	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		72'387'000	64'422'982	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.05.2023		10'352'000	898'140	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.05.2023		3'697'000	4'135'501	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.05.2023		2'587'000	215'342	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.05.2023		467'000	114'312	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2023		9'518'000	9'352'101	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.05.2023		3'421'000	2'012'027	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.05.2023		6'492'000	736'031	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.05.2023		101'000	55'520	NZD/CHF		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		5'986'900	915'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		869'515	6'605'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		3'276'055	5'007'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		66'592'750	75'084'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		939'686	10'852'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		4'294'656	3'850'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		221'893	2'671'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.06.2023		112'288	460'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		9'716'548	9'906'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		2'064'626	3'518'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		740'103	6'542'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		64'637	118'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		27'615	4'166'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		31'295	53'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		26'043	40'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		750'844	849'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		31'484	239'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		28'834	48'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		43'620	498'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		170'717	174'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		44'402	67'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		61'633	9'306'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		91'027	81'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		619'557	696'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		182'266	27'596'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		34'869	58'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		177'490	182'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		81'673	123'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.06.2023		17'240	71'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		94'263	84'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		1'426'081	1'604'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		30'408	268'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		22'000	24'598	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		49'000	32'605	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		8'932'000	58'154	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		460'000	415'862	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.06.2023		2'671'000	219'156	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		531'000	129'978	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		3'677'000	2'175'460	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		5'188'000	3'489'293	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		3'993'000	4'524'428	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		11'350'000	953'400	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.06.2023		118'000	64'646	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		77'773'000	71'090'744	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.06.2023		6'810'000	795'306	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		947'336'000	6'197'851	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		546'000	368'430	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		6'844'000	895'743	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		10'262'000	10'001'653	EUR/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		339'959	511'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		23'451	35'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2023		10'571'000	10'316'979	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.07.2023		7'199'000	943'645	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.07.2023		2'567'000	214'345	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.07.2023		1'071'207'000	6'630'129	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.07.2023		6'697'000	764'489	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.07.2023		3'872'000	2'305'699	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.07.2023		506'000	121'976	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.07.2023		84'003'000	75'147'404	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.07.2023		5'305'000	3'586'445	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.07.2023		572'000	378'098	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.07.2023		4'060'000	4'617'479	GBP/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SEK Verfall 04.07.2023		11'722'000	970'816	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.07.2023		128'000	70'152	NZD/CHF		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		210'145	2'567'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.07.2023		123'547	506'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		2'114'321	3'583'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		3'293'727	4'912'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		4'293'461	3'801'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		913'725	10'900'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.07.2023		69'845	128'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		70'929'922	77'899'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		729'415	6'265'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		6'514'795	994'531'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		356'050	529'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		882'538	6'754'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		9'592'505	9'861'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		20'283	18'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		21'113	3'254'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		57'186	59'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		491'585	547'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		202'000	180'274	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		76'000	74'440	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		348'000	312'432	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		5'070'000	32'265	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		20'000	22'873	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		40'700	60'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		185'067	207'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		29'063	48'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		226'617	333'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		298'032	261'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		58'696	445'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		49'429	432'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		28'687	43'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		5'403'885	6'031'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		493'244	78'492'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		68'887	822'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		146'044	241'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		714'227	727'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		131'000	117'576	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		11'217'136	11'511'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		985'135	7'525'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		241'097	2'893'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		7'616'184	1'228'825'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		838'939	7'367'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		2'483'798	4'180'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		136'354	567'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		84'634'346	94'889'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		3'921'816	5'816'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		405'071	614'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		4'932'736	4'349'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		1'059'474	12'814'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		73'213	134'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		35'000	23'380	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		10'000	5'940	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.08.2023		44'000	4'993	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		10'000	9'735	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		24'000	21'313	USD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		29'353	45'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		11'265	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		67'604	524'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		246'938	379'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		45'287	412'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		520'034	84'414'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		23'959	37'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		168'864	291'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		5'509'909	6'419'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		339'638	307'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		87'380	1'045'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		778'618	810'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		283'000	244'687	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		87'000	83'891	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		4'666'000	5'203'710	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		6'205'000	4'086'241	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		4'461'000	2'605'670	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.08.2023		7'735'000	859'730	HKD/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/ILS Verfall 03.08.2023		567'000	134'152		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023	1'313'239'000		8'011'808		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.08.2023		134'000	72'288		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.08.2023		8'049'000	1'032'204		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		13'859'000	1'143'229		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		12'224'000	11'682'477		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.08.2023		2'893'000	247'872		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		101'001'000	87'548'677		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.08.2023		651'000	424'979		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.09.2023		3'162'000	262'541		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.09.2023		8'000'000	901'120		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.09.2023		642'000	149'297		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.09.2023		697'000	455'873		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2023		4'684'000	2'679'576		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2023		14'162'000	1'142'449		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2023		142'000	74'686		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2023		4'891'000	5'474'301		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.09.2023		8'118'000	1'044'056		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		108'644'000	95'964'159		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2023	1'329'474'000		8'066'185		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2023		12'885'000	12'352'205		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2023		6'493'000	4'239'085		CAD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		5'416'125	4'873'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		4'262'512	6'493'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		886'200	8'000'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		2'693'124	4'622'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		151'497	642'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		8'104'009	1'326'304'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		76'334	142'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		1'039'331	8'118'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		1'165'887	14'162'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		12'314'873	12'911'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		270'259	3'162'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		93'447'273	108'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		454'085	697'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		48'884	56'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		19'951	18'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		26'000	24'953		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2023		234'000	203'471		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2023		3'538'000	21'788		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		554'215	632'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		34'930	62'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		40'377	6'708'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		262'466	3'168'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		143'412	618'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		436'110	668'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		2'620'500	4'590'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		1'101'075	13'672'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.10.2023		71'317	136'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		5'287'599	4'738'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		1'149'413	8'950'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		93'389'031	106'054'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		8'052'462	1'325'327'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		11'953'242	12'490'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		4'173'743	6'410'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		72'453	11'935'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		236'429	264'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		115'922	127'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		47'376	70'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		49'249	51'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		72'000	69'585		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		377'000	31'460		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		160'000	147'056		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		4'590'000	2'710'312		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		8'950'000	1'162'516		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		13'295'000	1'119'572		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.10.2023		7'286'000	851'085		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.10.2023		3'168'000	272'321		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		106'285'000	97'234'832		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.10.2023		136'000	74'756		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.10.2023		618'000	148'512		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		668'000	447'740		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		6'480'000	4'384'757		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023	1'337'262'000		8'198'218		JPY/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		12'469'000	12'077'473		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		4'738'000	5'290'498		GBP/CHF	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		819'260	7'286'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		2'530'089	4'294'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		1'124'810	8'674'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		1'071'968	12'755'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		771'336	6'620'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		280'508	3'271'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		89'080'417	97'685'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		72'328	132'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2023		127'819	533'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		438'204	655'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		4'089'817	6'061'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		8'085'524	1'316'807'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		11'116'026	11'499'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		5'253'417	4'719'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		230'982	252'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		14'438	13'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		20'826	3'370'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		26'923	28'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		156'786	172'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		24'939	28'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		21'644	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		60'000	39'012		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		87'000	82'339		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		877'000	782'894		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		79'000	44'850		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		13'384'000	79'809		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		35'000	38'052		GBP/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		74'005	82'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		24'102	37'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		4'215'000	2'428'809		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		132'000	69'872		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		4'717'000	5'209'266		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.11.2023		6'620'000	769'906		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		11'440'000	11'005'280		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		12'755'000	1'039'022		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		97'342'000	88'590'954		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		1'306'793'000	7'853'042		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		8'674'000	1'117'818		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		3'271'000	266'488		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		6'038'000	3'958'332		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		533'000	119'893		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.11.2023		655'000	435'103		SGD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		2'361'587	4'108'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		69'642	132'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		5'064'850	4'601'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		781'391	6'737'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		10'743'002	11'191'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		991'758	12'201'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		7'556'942	1'255'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		86'481'159	95'347'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		1'124'904	8'745'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		254'863	3'136'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'876'002	5'930'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		122'967	548'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		423'620	639'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		23'610	41'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		4'397'749	6'836'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		315'702	3'826'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		2'800'724	4'842'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		8'751'577	1'467'472'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		486'944	738'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		71'232	134'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		12'601'253	13'038'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		1'311'568	10'117'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		98'086'139	111'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		147'843	624'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		1'192'617	14'122'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		892'951	7'879'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		5'964'558	5'405'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		665'000	586'315		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		352'500	400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		8'991'000	5'183'581		AUD/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 CHF	in % 7)	Kat.
CHF/ILS	Verfall 04.12.2023		1'172'000	273'662	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 04.12.2023		26'323'000	2'184'019	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 04.12.2023		6'962'000	561'555	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 04.12.2023		14'616'000	1'627'170	HKD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.12.2023		24'229'000	22'986'052	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.12.2023		12'766'000	8'186'836	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 04.12.2023		266'000	142'855	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 04.12.2023		1'377'000	897'129	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.12.2023		2'722'972'000	16'015'432	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.12.2023		10'006'000	11'014'004	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.12.2023		206'152'000	179'251'226	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 04.12.2023		18'862'000	2'400'001	DKK/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		5'597'108	9'733'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.01.2024		268'499	1'153'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.01.2024		2'243'073	27'086'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 04.01.2024		585'742	7'281'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'656'170	14'930'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		25'786'971	27'239'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		9'027'453	14'120'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.01.2024		164'313	307'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'035'657	1'593'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		11'472'762	10'457'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		201'078'830	232'090'000	CHF/USD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.01.2024		2'561'310	20'167'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		80'434	125'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		87'884	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		163'187	173'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		30'606	53'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'572'656	1'809'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		30'822	28'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		253'568	289'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		24'589	26'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		168'736	195'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		64'079	99'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		62'262	107'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.01.2024		51'000	32'928	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		146'000	125'545	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.01.2024		48'000	27'963	AUD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		219'647	257'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		85'692	91'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 04.01.2024		7'281'000	603'304	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 04.01.2024		307'000	163'588	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 04.01.2024		1'593'000	1'016'366	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		234'494'000	197'352'495	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.01.2024		14'293'000	9'122'650	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 04.01.2024		20'167'000	2'515'027	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 04.01.2024		27'086'000	2'261'681	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 04.01.2024		2'986'788'000	17'830'228	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.01.2024		9'845'000	5'653'688	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.01.2024		10'565'000	11'335'189	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.01.2024		27'529'000	25'592'335	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 04.01.2024		1'153'000	269'479	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 04.01.2024		14'930'000	1'609'155	HKD/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2024		17'472'440	2'966'121'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2024		122'291	20'667'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.02.2024		632'845	7'656'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 02.02.2024		180'627	340'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'108'782	1'741'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		213'003'995	253'876'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		9'676'833	15'202'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2024		2'655'108	21'326'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2024		2'504'020	30'048'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2024		18'340'828	3'067'854'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2024		6'259'605	10'924'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2024		12'097'050	11'308'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		27'164'849	29'276'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 02.02.2024		281'757	1'209'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'702'851	15'839'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2024		119'364	188'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'017'936	1'201'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2024		54'428	9'252'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2024		62'270	67'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2024		52'942	93'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 02.02.2024		29'000	31'264	GBP/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 CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		335'000	283'168		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		30'000	19'040		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		52'000	48'304		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		55'000	51'293		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		948'753	1'117'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		41'821	7'107'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		136'087	146'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		202'252	233'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		50'000	28'440		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		1'107'000	955'303		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		210'000	230'542		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		1'209'000	285'082		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2024		340'000	179'537		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		254'985'000	218'728'683		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.02.2024		15'839'000	1'738'235		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		7'656'000	628'175		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		21'326'000	2'665'963		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		11'069'000	12'091'222		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		30'048'000	2'495'186		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		29'382'000	27'376'679		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		15'360'000	9'861'888		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		10'967'000	6'218'837		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		1'741'000	1'117'670		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		3'084'213'000	18'099'396		JPY/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.03.2024		288'141	1'225'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		179'469	341'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		223'406'220	261'325'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.03.2024		1'600'225	14'617'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		612'795	7'488'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		2'867'175	22'976'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		12'381'339	11'370'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		2'479'901	29'927'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		27'512'343	29'588'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		9'956'440	15'553'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		6'209'491	10'977'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'087'254	1'697'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		19'400'882	3'301'081'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		56'819	52'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		59'850	10'239'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		17'533	140'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		17'329	27'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		1'186'753	1'375'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		208'128	223'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		37'000	40'943		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		50'000	47'330		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		411'000	361'318		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		9'347'000	8'230'342		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		468'000	522'472		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		622'000	79'535		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.03.2024		410'000	267'395		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		1'224'000	1'166'581		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.03.2024		178'000	102'845		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		70'310'000	411'655		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		10'917'000	12'160'555		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		1'225'000	301'999		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		252'942'000	222'717'960		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		28'537'000	27'191'480		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		3'241'010'000	19'066'862		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.03.2024		10'799'000	6'192'147		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		29'927'000	2'547'087		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.03.2024		7'488'000	622'178		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		22'494'000	2'875'183		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.03.2024		1'697'000	1'111'382		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.03.2024		15'170'000	9'848'971		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.03.2024		14'617'000	1'644'135		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.03.2024		341'000	182'947		NZD/CHF	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		11'817'813	10'642'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		316'771	1'288'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		223'492'299	254'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		27'478'591	28'897'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		19'619'036	3'330'041'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		6'031'281	10'543'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		2'525'631	29'735'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 03.04.2024		556'795	6'718'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)

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 CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		3'043'922	23'855'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		1'055'608	1'615'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		9'534'510	14'727'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 03.04.2024		1'580'366	14'084'000		CHF/HKD	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 03.04.2024		178'078	333'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)

Devisentermingeschäfte auf Klassen

0.00 0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'296'160.06	0.45
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	72'748'996.79	6.15
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'105'073'929.18	93.38
Sonstige Vermögenswerte	309'093.78	0.03
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'183'428'179.81	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-2'566'508.84	
Andere Verbindlichkeiten	-112'557.73	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'180'749'113.24	

Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	1'177'822'925.97	99.53
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

AUD	1 = CHF	0.57337013
CAD	1 = CHF	0.64920559
DKK	100 = CHF	12.78327000
EUR	1 = CHF	0.95288338
GBP	1 = CHF	1.11385172
HKD	100 = CHF	11.24757300
ILS	1 = CHF	0.24654217
JPY	100 = CHF	0.58832800
NOK	100 = CHF	8.30766300
NZD	1 = CHF	0.53647509
SEK	100 = CHF	8.50982600
SGD	1 = CHF	0.65487877
USD	1 = CHF	0.88055000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	6'141'123.69	0.520
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	308'094'478.66	26.093

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 CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.050	0.00 - 0.04	-	0.008
GT USD	CHF	0.00 - 0.08	-	0.050	0.00 - 0.04	-	0.008
NA CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.050	0.00 - 0.04	-	0.008
NT CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.050	0.00 - 0.04	-	0.008
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.050	0.00 - 0.04	-	0.008

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2023 - 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 CHF	0.250	0.500	0.150	0.100	3.000
GT USD	0.220	0.350	0.170	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000

Periode: 19.09.2023 - 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
NA 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 World ex Switzerland 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 CHF	Ja	CHF	-	-	-
NA CHF	Ja	CHF	-	-	-

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	CHF	0.09298	0.03254	0.06044
NT CHF	Ja	CHF	0.42726	0.14954	0.27772
NTH1 CHF	Ja	CHF	0.37179	0.13012	0.24167

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

Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

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

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 Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I)

(nachfolgend das "übertragende Teilvermögen") und

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

(nachfolgend das "übernehmende Teilvermögen")

zwei Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung vom 25. Juli 2023

Zur Bekanntgabe:

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

1 Vollzug der Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Teilvermögen per 25. Juli 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen über die geplante Vereinigung und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 25. Juli 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Teilvermögens auch für das übertragende Teilvermögen.

2 Umtauschverhältnisse

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

2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Teilvermögen in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 25. Juli 2023:

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen)			Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen)		
	ISIN	NAV pro Anteil		ISIN	NAV pro Anteil
FA CHF	CH0315621307	70.93	FA CHF	CH1270020246	70.93
DT CHF	CH0117045291	79.46	FA CHF	CH1270020246	70.93
GT CHF	CH0342828479	76.10	GT CHF	CH1270020279	76.10
NT CHF	CH0117045283	80.75	NT CHF	CH1270020295	80.75

2.2 Umtauschverhältnisse

Entsprechend ergibt sich das folgende Umtauschverhältnis jeweils aus Sicht des übertragenden Teilvermögens (1 Anteil des übertragenden Teilvermögens ↔ Anzahl Anteile am übernehmenden Teilvermögen):

Swisscanto (CH) Pension Equity Fund Responsible Europe ex CH (übertragendes Teilvermögen)	
Anteilsklasse	Umtauschverhältnis¹
FA CHF	1 ↔ 1.0000000000
DT CHF	1 ↔ 1.1202372991
GT CHF	1 ↔ 1.0000000000
NT CHF	1 ↔ 1.0000000000

¹ Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 8. August 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung wie folgt:

"Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die Berechnung der Umtauschverhältnisse im Zusammenhang mit der Vereinigung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) (übertragendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) mit dem Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. hedged CHF (übernehmendes Teilvermögen des Umbrellafonds Swisscanto (CH) Index Fund V) per 25. Juli 2023 geprüft.

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

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

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung der oben erwähnten Teilvermögen korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt."

Ernst & Young AG

Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag, 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, 11. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

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

(nachfolgend das "Teilvermögen")

ein Teilvermögen des vertraglichen Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"

Swisscanto (CH) Index Fund V

(nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

betreffend

Vereinigung von Anteilsklassen per 10. August 2023

Die mit Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger vom 24. Mai 2023 im Publikationsorgan des Umbrella-Fonds angekündigte Vereinigung von Anteilsklassen des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Bond Fund World (ex CHF) Govt. (I) des Umbrella-Fonds wurde vollzogen.

Nachstehend wird für das genannte Teilvermögen das Umtauschverhältnis für die Vereinigung der übertragenden Anteilsklasse mit der übernehmenden Anteilsklasse basierend auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 10. August 2023 aufgeführt.

Anteilsklasse DTH1 CHF (übertragende)			Anteilsklasse FAH1 CHF (übernehmende)			
Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil	Umtauschverhältnis	Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
DTH1 CHF	CH0117045325	93.42	1 ↔ 1.2900884308	FAH1 CHF	CH0315621315	72.41

Die Anleger werden darauf hingewiesen, dass die Frist zur Erhebung von Einwendungen gegen die oben erwähnte Vereinigung von Anteilsklassen abgelaufen ist und Einwendungen gegen diese Vereinigung nicht mehr möglich sind.

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

Zürich, 15. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Australia Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Canada Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund UK Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund World Rest Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Japan Govt.

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Large Caps Switzerland

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

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

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

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

mit den Teilvermögen

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Europe ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA

Swisscanto (CH) Index Equity Fund USA Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Japan Responsible

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Pacific ex Japan

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Canada

Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

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

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets

Swisscanto (CH) Index Equity Fund Emerging Markets Responsible

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

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

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

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen den Vereinigungen

1 Geplante Vereinigung

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

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

2 Gründe für die Vereinigungen

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

3 Voraussetzungen für die Vereinigungen

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

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

4 Vereinigungsverfahren

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

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

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

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

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

6 Vollzug der Vereinigungen

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

7 Kosten

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

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

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

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Austria Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Belgium Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Finland Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund France Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Germany Govt.

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Ireland Govt.

(bis 15.00 Uhr)

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Italy Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Netherlands Govt.

Swisscanto (CH) Index Bond Fund Spain Govt.

(übertragende Teilvermögen)

Letzter Cut Off

20. November 2023

Swisscanto (CH) Index Bond Fund EMU Govt.

(bis 15.00 Uhr)

(übernehmendes Teilvermögen)

Geschlossen

21. November 2023 bis

(kein Cut Off von/bis)

27. November 2023

Stichtag Vereinigung

22. November 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigungen

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

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag der übertragenden Teilvermögen

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

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

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

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

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Das Teilvermögen

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

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

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

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

2.2 Flüssige Mittel

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

2.3 Anlagetechniken und -instrumente

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2.4 Risikoverteilung und Risiken

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

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

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

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

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

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

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

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

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

5 Rücknahmebedingungen

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

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

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

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

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

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

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

Zürich, 18. September 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto (CH) Index Fund 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 Anteilklassen 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

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

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

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

betreffend die 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 World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

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

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist die Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Zudem wird bei 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 und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible neu eine Bestimmung betreffend Gating aufgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.1 dieser Veröffentlichung).

Es werden überdies bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect Änderungen in den bestehenden Gating-Bestimmungen vorgenommen (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2.2 dieser Veröffentlichung).

Neben den in dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages werden zusätzlich einzelne Anpassungen formeller Natur vorgenommen.

1 Änderungen der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH

Die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, soll gestrichen werden.

2 Gating-Verfahren

2.1 Einführung Gating-Verfahren bei 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 und Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible

Bei den oben aufgeführten Teilvermögen werden neue Bestimmungen betreffend Gating aufgenommen (vgl. Ziff. 8 und Ziff. 9 in § 17 des angepassten Fondsvertrages).

Die Fondsleitung behält sich bei den nachstehend (in Ziff. 9 von § 17 des angepassten Fondsvertrages) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung angegeben (vgl. §17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages). Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Gleichsam behält sich die Fondsleitung bei den (unter Ziff. 9 von § 17) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen vorhandenen Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung (vgl. Ziff. 9 von § 17) angegeben. Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt (vorbehältlich § 17 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie § 5 Ziff. 8 des Fondsvertrages). Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

In § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages werden die Teilvermögen mit Gating bei einem Rücknahmeüberhang bzw. Zeichnungsüberhang mit entsprechenden **Mindest-Schwellenwerten** aufgeführt. Bei den nachstehenden Teilvermögen sind folgende Werte massgebend:

– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)	mind.	CHF 120'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible	mind.	CHF 100'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland	mind.	CHF 20'000'000
– Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible	mind.	CHF 20'000'000

Bei den im Prospekt in Ziff. 1.8 angegeben **effektiven Schwellenwerten** sind folgende Werte massgebend:

– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)	CHF 120'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total Responsible	CHF 100'000'000
– Swisscanto (CH) Index Equity Fund Small & Mid Caps Switzerland	CHF 25'000'000
– Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible	CHF 60'000'000

2.2 Änderung des Gating-Verfahrens bei den Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. und Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Bei den oben aufgeführten Teilvermögen bestehen bereits Bestimmungen betreffend Gating, welche neu umfassend angepasst werden (vgl. Ziff. 8 und Ziff. 9 in § 17 des angepassten Fondsvertrages).

Die Fondsleitung behält sich bei den nachstehend (in Ziff. 9 von § 17 des angepassten Fondsvertrages) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. bei einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der gehaltenen Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettorücknahmen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen verbleibenden Anleger, die Herabsetzung aller Rücknahmeanträge (Gating bei einem Rücknahmeüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettorücknahmen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung angegeben (vgl. § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages). Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Gleichsam behält sich die Fondsleitung bei den (unter Ziff. 9 von § 17) aufgeführten Teilvermögen unter ausserordentlichen Umständen, wie bspw. einer im Verhältnis zur effektiven Markttiefe der zu erwerbenden Anlagen hohen Gesamtsumme der Nettozeichnungen, im Interesse der im jeweiligen Teilvermögen vorhandenen Anleger, die Herabsetzung aller Zeichnungsanträge (Gating bei einem Zeichnungsüberhang) an Tagen vor, an welchen die Gesamtsumme der Nettozeichnungen den jeweiligen im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwert übersteigt. Der jeweilige Schwellenwert, der mindestens zur Anwendung kommt (Mindest-Schwellenwert), wird in der nachstehenden Bestimmung (vgl. Ziff. 9 von § 17) angegeben. Eine Änderung des im Prospekt angegebenen effektiven Schwellenwertes wird mindestens drei Tage vor Inkraftsetzung im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, publiziert. Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge proportional und im gleichen Verhältnis nach eigenem Ermessen zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahme- bzw. Zeichnungsanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt (vorbehältlich § 17 Ziff. 4 und Ziff. 5 sowie § 5 Ziff. 8 des Fondsvertrages). Eine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge findet somit nicht statt. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.

In § 17 Ziff. 9 des angepassten Fondsvertrages werden die Teilvermögen mit Gating bei einem Rücknahmeüberhang bzw. Zeichnungsüberhang mit entsprechenden **Mindest-Schwellenwerten** aufgeführt. Bei den nachstehenden Teilvermögen sind folgende Werte massgebend:

- | | | |
|---|-------|-----------------|
| – Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. | mind. | CNY 400'000'000 |
| – Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect | mind. | CHF 10'000'000 |

Bei den im Prospekt in Ziff. 1.8 angegeben **effektiven Schwellenwerten** sind folgende Werte massgebend:

- | | |
|---|-------------------|
| – Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt. | CNY 1'200'000'000 |
| – Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect | CHF 10'000'000 |

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 dieser Mitteilung umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser

Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 23. November 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"

betreffend die 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 World ex CH
Swisscanto (CH) Index Bond Fund China Govt.
Swisscanto (CH) Index Bond Fund Corp. CHF Responsible
Swisscanto (CH) Index Real Estate Fund Switzerland indirect

Mit Veröffentlichung vom 23. November 2023 wurden, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, von der Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, diverse Anpassungen des Fondsvertrages beantragt.

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist unter anderem die **Änderung der Anlagepolitik beim Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Equity Fund World ex CH**. Diese Anpassung beabsichtigt, dass die bestehende Limitierung in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages, wonach beim oben aufgeführten Teilvermögen Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen kollektiven Kapitalanlagen gemäss § 8 Ziff. 14 lit. d des Fondsvertrages 49% des Vermögens des Teilvermögens nicht überschreiten dürfen, gestrichen werden soll (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 der Veröffentlichung vom 23. November 2023).

In Zusammenhang mit der geplanten Änderung wird in der gleichen Bestimmung (in § 8 Ziff. 14 des Fondsvertrages) zudem neu die Regelung ergänzt, dass Investitionen in Anlagen in Anteile bzw. Aktien von anderen Dachfonds (Funds of Funds) ausdrücklich ausgeschlossen sind.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, der Jahres- und Halbjahresbericht sowie das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 22. Dezember 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich