

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND UK GOVT.

Halbjahresbericht per 31.07.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FA GBP	21580443	GBP
GT GBP	37925355	GBP
NT GBP	21580445	GBP
ST GBP	30246860	GBP

Rechnungswährung: GBP

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

Inhaltsverzeichnis

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

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.02.2024	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021
	bis	31.07.2024	31.01.2024	31.01.2023	31.01.2022
Konsolidiert					
	GBP				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		419'775'956.53	414'005'610.62	303'190'183.47	85'338'207.58
Klasse FA GBP					
	GBP				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		16'392'233.32	14'932'572.92	7'970'241.70	7'537'191.19
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		227'478.630	204'573.521	104'295.372	75'983.039
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		72.0605	72.9937	76.4199	99.1957
Ausschüttung je Anteil		-	1.80	1.85	1.60
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %
Klasse GT GBP					
	GBP				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		324'341'842.38	322'278'260.98	229'108'772.15	461'393.58
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		4'004'161.666	3'992'755.664	2'759'224.902	4'329.429
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		81.0012	80.7157	83.0337	106.5715
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		91.5829	88.1762	93.9172	133.1230
Thesaurierung je Anteil		-	2.07	1.91	1.88
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
Klasse NT GBP					
	GBP				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'662'095.17	23'714'573.91	22'747'363.29	29'374'241.09
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		237'718.766	239'140.542	223'172.542	224'730.566
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.5382	99.1658	101.9272	130.7087
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		112.5416	108.3317	115.2872	163.2739
Thesaurierung je Anteil		-	2.68	2.50	2.50
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse ST GBP					
	GBP				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		55'379'785.66	53'080'202.81	43'363'806.33	47'965'381.72
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		634.436	610.375	485.136	418.456
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		87'289.7907	86'963.2649	89'384.8453	114'624.6719
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		98'693.0769	95'001.1997	101'100.7963	143'182.6332
Thesaurierung je Anteil		-	2'355.75	2'196.91	2'193.91
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA GBP	1.24 %	3.67 %	-27.21 %	-5.61 %
Klasse GT GBP	1.28 %	3.72 %	-27.18 %	-5.55 %
Klasse NT GBP	1.35 %	3.87 %	-27.08 %	-5.41 %
Klasse ST GBP	1.35 %	3.87 %	-27.08 %	-5.41 %
Benchmark	1.32 %	3.83 %	-27.09 %	-5.44 %
Tracking Error 33)	-	0.07 %	0.06 %	0.05 %

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 GBP	-0.08 %
Klasse GT GBP	-0.04 %
Klasse NT GBP	0.03 %
Klasse ST GBP	0.03 %

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.07.2024	31.01.2024
Bankguthaben auf Sicht	1'619'601.60	5'529'738.27
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	416'229'252.34	406'739'840.23
Sonstige Vermögenswerte	1'970'324.88	1'779'414.00
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	419'819'178.82	414'048'992.50
Andere Verbindlichkeiten	-43'222.29	-43'381.88
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	419'775'956.53	414'005'610.62

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Klasse FA GBP			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		204'573.521	104'295.372
Ausgegebene Anteile		52'714.238	142'949.399
Zurückgenommene Anteile		-29'809.129	-42'671.250
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		227'478.630	204'573.521
Klasse GT GBP			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'992'755.664	2'759'224.902
Ausgegebene Anteile		289'839.456	2'331'244.868
Zurückgenommene Anteile		-278'433.454	-1'097'714.106
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		4'004'161.666	3'992'755.664
Klasse NT GBP			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		239'140.542	223'172.542
Ausgegebene Anteile		3'030.978	843'933.079
Zurückgenommene Anteile		-4'452.754	-827'965.079
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		237'718.766	239'140.542
Klasse ST GBP			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		610.375	485.136
Ausgegebene Anteile		58.380	193.961
Zurückgenommene Anteile		-34.319	-68.722
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		634.436	610.375

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		414'005'610.62	303'190'183.47
Ausbezahlte Ausschüttung		-399'775.68	-265'966.94
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'572'120.17	-2'550'424.04
Saldo aus dem Anteilverkehr		4'296'900.56	114'226'701.11
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		5'445'341.20	-594'882.98
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		419'775'956.53	414'005'610.62

Erfolgsrechnung

	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		29'241.40	39'447.33
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		6'119'273.13	10'021'693.15
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		243'876.30	3'701'410.02
Total Ertrag		6'392'390.83	13'762'550.50
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-0.85
Reglementarische Vergütungen		-235'252.81	-380'729.36
Sonstige Aufwendungen		0.00	-0.31
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-147'980.79	-2'628'742.27
Total Aufwand		-383'233.60	-3'009'472.79
Nettoertrag / Verlust		6'009'157.23	10'753'077.71
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'538'258.51	-19'044'447.57
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		24'868.33	396'401.23
Realisierter Erfolg		4'495'767.05	-7'894'968.63
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		949'574.15	7'300'085.65
Gesamterfolg		5'445'341.20	-594'882.98

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert GBP	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							416'229'252.34	99.14	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							416'229'252.34	99.14	
GB0002404191	6.0000 % UKT 6 12/07/28	5'095	0	190	4'905 GBP	108.90%	5'341'545.00	1.27	a)
GB0004893086	4.2500 % UKT 4 1/4 06/07/32	9'325	0	565	8'760 GBP	102.80%	9'005'280.00	2.15	a)
GB0030880693	5.0000 % UKT 5 03/07/25	7'612	0	7'612	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB0032452392	4.2500 % UKT 4 1/4 03/07/36	7'412	367	200	7'579 GBP	101.42%	7'686'886.66	1.83	a)
GB00B00NY175	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/38	6'648	180	200	6'628 GBP	105.43%	6'987'900.40	1.66	a)
GB00B06YGN05	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/55	7'533	0	615	6'918 GBP	95.46%	6'603'922.80	1.57	a)
GB00B128DP45	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/46	7'346	50	470	6'926 GBP	96.33%	6'671'815.80	1.59	a)
GB00B16NNR78	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/27	6'771	0	450	6'321 GBP	101.18%	6'395'587.80	1.52	a)
GB00B1VWPJ53	4.5000 % UKT 4 1/2 12/07/42	8'571	100	545	8'126 GBP	100.96%	8'204'009.60	1.95	a)
GB00B24FF097	4.7500 % UKT 4 3/4 12/07/30	8'534	0	0	8'534 GBP	105.25%	8'982'035.00	2.14	a)
GB00B39R3707	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/49	5'609	100	305	5'404 GBP	95.87%	5'180'814.80	1.23	a)
GB00B3KJDS62	4.2500 % UKT 4 1/4 09/07/39	5'715	100	475	5'340 GBP	99.45%	5'310'630.00	1.26	a)
GB00B52WS153	4.5000 % UKT 4 1/2 09/07/34	6'223	200	295	6'128 GBP	104.04%	6'375'571.20	1.52	a)
GB00B54QLM75	4.0000 % UKT 4 01/22/60	5'812	0	395	5'417 GBP	91.37%	4'949'512.90	1.18	a)
GB00B6460505	4.2500 % UKT 4 1/4 12/07/40	6'608	0	470	6'138 GBP	98.73%	6'060'047.40	1.44	a)
GB00B6RNNH572	3.7500 % UKT 3 3/4 07/22/52	5'687	0	395	5'292 GBP	87.83%	4'647'963.60	1.11	a)
GB00B84Z9V04	3.2500 % UKT 3 1/4 01/22/44	9'601	300	845	9'056 GBP	84.30%	7'634'208.00	1.82	a)
GB00BBJNQY21	3.5000 % UKT 3 1/2 07/22/68	6'700	150	505	6'345 GBP	82.46%	5'232'087.00	1.25	a)
GB00BD0XH204	1.7500 % UKT 1 3/4 07/22/57	8'437	300	365	8'372 GBP	53.76%	4'500'787.20	1.07	a)
GB00BDCHBW80	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/47	8'249	0	650	7'599 GBP	57.33%	4'356'506.70	1.04	a)
GB00BDRHNP05	1.2500 % UKT 1 1/4 07/22/27	6'676	800	415	7'061 GBP	92.78%	6'551'195.80	1.56	a)
GB00BFMNC652	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/2071	6'470	985	0	7'455 GBP	46.62%	3'475'521.00	0.83	a)
GB00BFWFPP71	1.7500 % UKT 1 3/4 01/22/49	5'085	200	625	4'660 GBP	59.49%	2'772'234.00	0.66	a)
GB00BFX0ZL78	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/28	6'478	150	410	6'218 GBP	91.89%	5'713'720.20	1.36	a)
GB00BJLR0J16	1.6250 % UKT 1 5/8 10/22/54	6'022	0	420	5'602 GBP	52.97%	2'967'379.40	0.71	a)
GB00BJMHB534	0.8750 % UKT 0 7/8 10/22/29	6'809	0	245	6'564 GBP	86.62%	5'685'736.80	1.35	a)
GB00BJQWYH73	1.2500 % UKT 1 1/4 10/22/41	10'790	0	625	10'165 GBP	62.56%	6'359'224.00	1.51	a)
GB00BK5CVX03	0.6250 % UKT 0 5/8 06/07/25	6'810	0	6'810	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BL68HH02	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/30	7'850	400	835	7'415 GBP	81.49%	6'042'483.50	1.44	a)
GB00BL68HJ26	0.1250 % UKT 0 1/8 01/30/26	6'679	0	465	6'214 GBP	94.67%	5'882'793.80	1.40	a)
GB00BL6C7720	4.1250 % UKT 4 1/8 01/29/27	13'950	0	970	12'980 GBP	100.01%	12'981'298.00	3.09	a)
GB00BLBDX619	1.1250 % UKT 1 1/8 10/22/2073	4'693	0	325	4'368 GBP	37.15%	1'622'712.00	0.39	a)
GB00BLH38158	1.2500 % UKT 1 1/4 07/31/51	11'608	0	935	10'673 GBP	49.65%	5'299'144.50	1.26	a)
GB00BLPK7110	0.2500 % UKT 0 1/4 01/31/25	12'731	0	12'731	0 GBP	0.00%	0.00	0.00	
GB00BLPK7227	0.5000 % UKT 0 1/2 01/31/29	11'828	400	650	11'578 GBP	86.56%	10'021'916.80	2.39	a)
GB00BLPK7334	1.1250 % UKT 1 1/8 01/31/39	10'461	200	665	9'996 GBP	66.26%	6'623'349.60	1.58	a)
GB00BM8Z2521	0.8750 % UKT 0 7/8 07/31/33	11'677	1'000	585	12'092 GBP	76.95%	9'304'794.00	2.22	a)
GB00BM8Z2T38	1.0000 % UKT 1 01/31/32	14'991	69	600	14'460 GBP	81.60%	11'799'687.58	2.81	a)
GB00BM8Z2V59	1.5000 % UKT 1 1/2 07/31/53	7'611	1'470	200	8'881 GBP	51.74%	4'595'029.40	1.09	a)
GB00BMBL1D50	0.5000 % UKT 0 1/2 10/22/61	9'581	950	510	10'021 GBP	30.93%	3'099'495.30	0.74	a)
GB00BMBL1F74	0.6250 % UKT 0 5/8 10/22/50	7'866	250	155	7'961 GBP	41.29%	3'287'096.90	0.78	a)
GB00BMBL1G81	0.1250 % UKT 0 1/8 01/31/28	6'835	650	0	7'485 GBP	88.30%	6'609'255.00	1.57	a)
GB00BMF9LF76	4.0000 % UKT 4 10/22/63	4'390	1'700	290	5'800 GBP	91.00%	5'278'000.00	1.26	a)
GB00BMF9LG83	4.5000 % UKT 4 1/2 06/07/28	9'675	4'425	260	13'840 GBP	101.98%	14'114'032.00	3.36	a)
GB00BMGR2809	0.2500 % UKT 0 1/4 07/31/31	11'805	200	430	11'575 GBP	78.44%	9'079'430.00	2.16	a)
GB00BMGR2916	0.6250 % UKT 0 5/8 07/31/35	9'209	200	615	8'794 GBP	69.87%	6'144'367.80	1.46	a)
GB00BMV7TC88	3.2500 % UKT 3 1/4 01/31/33	14'435	200	1'005	13'630 GBP	95.15%	12'968'945.00	3.09	a)
GB00BN65R313	3.5000 % UKT 3 1/2 01/22/45	8'613	0	315	8'298 GBP	86.92%	7'212'621.60	1.72	a)
GB00BNNGP668	0.3750 % UKT 0 3/8 10/22/26	11'736	0	820	10'916 GBP	92.45%	10'091'842.00	2.40	a)
GB00BNNGP775	0.8750 % UKT 0 7/8 01/31/46	7'454	100	680	6'874 GBP	50.70%	3'485'118.00	0.83	a)
GB00BPCJD880	3.5000 % UKT 3 1/2 10/22/25	15'410	700	1'770	14'340 GBP	98.73%	14'157'882.00	3.37	a)
GB00BPCJD997	3.7500 % UKT 3 3/4 10/22/53	11'770	450	955	11'265 GBP	87.29%	9'833'218.50	2.34	a)
GB00BPJKN53	4.6250 % UKT 4 5/8 01/31/34	5'220	7'755	0	12'975 GBP	105.05%	13'630'237.50	3.25	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2024	Kurs 8)	Kurswert GBP	in % 7)	Kat.
GB00BPJJKP77	4.7500 % UKT 4 3/4 10/22/43	3'050	4'835	180	7'705 GBP	103.71%	7'990'855.50	1.90	a)
GB00BPSNB460	3.7500 % UKT 3 3/4 03/07/27	0	10'360	145	10'215 GBP	99.04%	10'116'936.00	2.41	a)
GB00BPSNB36	4.3750 % UKT 4 3/8 07/31/54	0	5'700	0	5'700 GBP	97.18%	5'539'260.00	1.32	a)
GB00BPSNBF73	4.0000 % UKT 4 10/22/31	0	3'675	0	3'675 GBP	100.67%	3'699'622.50	0.88	a)
GB00BQC4R999	3.7500 % UKT 3 3/4 01/29/38	8'120	1'650	290	9'480 GBP	95.36%	9'040'128.00	2.15	a)
GB00BQC82B83	4.1250 % UKT 4 1/8 07/22/29	0	6'445	0	6'445 GBP	100.96%	6'506'872.00	1.55	a)
GB00BQC82C90	4.2500 % UKT 4 1/4 07/31/34	0	4'500	0	4'500 GBP	101.91%	4'585'950.00	1.09	a)
GB00BTHH2R79	2.0000 % UKT 2 09/07/25	5'936	0	730	5'206 GBP	97.38%	5'069'602.80	1.21	a)
GB00BYMZ75	2.5000 % UKT 2 1/2 07/22/65	6'561	100	370	6'291 GBP	63.95%	4'022'842.86	0.96	a)
GB00BYZW3G56	1.5000 % UKT 1 1/2 07/22/26	7'034	0	490	6'544 GBP	95.29%	6'235'515.84	1.49	a)
GB00BZB26Y51	1.7500 % UKT 1 3/4 09/07/37	9'325	200	815	8'710 GBP	75.83%	6'604'793.00	1.57	a)
GBP							416'229'252.34	99.14	

Vermögensaufstellung

	Kurswert GBP	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'619'601.60	0.39
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	416'229'252.34	99.14
Sonstige Vermögenswerte	1'970'324.88	0.47
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	419'819'178.82	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-43'222.29	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	419'775'956.53	

Bewertungskategorien

	Kurswert GBP	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);	416'229'252.34	99.14
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

Devisenkurse

CHF	1 = GBP	0.88445708
-----	---------	------------

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	GBP	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	GBP	-	-

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2024 - 31.07.2024

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 GBP	GBP	0.00 - 0.14	-	0.059	-	-	-
GT GBP	GBP	0.00 - 0.14	-	0.059	-	-	-
NT GBP	GBP	0.00 - 0.14	-	0.059	-	-	-
ST GBP	GBP	0.00 - 0.14	-	0.059	-	-	-

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	GBP	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2024 - 31.07.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
FA GBP	0.200	0.500	0.100	0.100	-
GT GBP	0.140	0.350	0.090	0.050	-
NT GBP	-	-	-	-	-
ST GBP	-	-	-	-	-

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

FTSE UK Government Bond Index

9 TER

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

10 Fussnoten

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

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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

anfallen;

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