

SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD REST 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 CHF	21580450	CHF
NT CHF	21580458	CHF
ST CHF	30246910	CHF

Rechnungswährung: CHF

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	10
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	10
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	11
7	Pauschale Verwaltungskommission	11
8	Benchmark	11
9	TER	11
10	Fussnoten	12
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	13

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					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		102'986'997.75	107'426'796.35	94'375'339.45	74'857'036.85
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		260'468.08	265'732.47	339'204.09	294'695.44
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'586.283	3'586.283	4'336.283	3'422.283
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		72.6290	74.0969	78.2246	86.1108
Ausschüttung je Anteil		-	2.75	2.70	2.60
Total Expense Ratio (TER)		0.29 %	0.29 %	0.29 %	0.29 %
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		62'563'129.72	67'949'560.24	57'853'077.50	37'165'057.44
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		776'559.792	846'982.617	700'809.798	418'336.430
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		80.5645	80.2254	82.5518	88.8401
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		91.5245	93.5192	89.8522	95.4193
Thesaurierung je Anteil		-	3.18	2.96	2.93
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse ST CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		40'163'399.95	39'211'503.64	36'183'057.86	37'397'283.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		457.219	448.269	401.991	386.072
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		87'842.8061	87'473.1548	90'009.6218	96'866.0871
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		99'793.0202	101'967.8905	97'969.6563	104'039.6188
Thesaurierung je Anteil		-	3'469.89	3'230.13	3'203.25
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 CHF	1.62 %	1.55 %	-9.07 %	-5.17 %
Klasse NT CHF	1.77 %	1.84 %	-8.80 %	-4.89 %
Klasse ST CHF	1.77 %	1.84 %	-8.80 %	-4.89 %
Benchmark	1.77 %	1.88 %	-8.85 %	-4.84 %
Tracking Error ³³⁾	-	0.10 %	0.09 %	0.07 %

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	-0.15 %
Klasse NT CHF	-
Klasse ST CHF	-

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	384'018.53	8'896'131.67
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	101'417'716.43	98'844'250.34
Sonstige Vermögenswerte	1'185'331.71	1'130'052.95
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	102'987'066.67	108'870'434.96
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-1'443'569.07
Andere Verbindlichkeiten	-68.92	-69.54
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	102'986'997.75	107'426'796.35

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FA CHF	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'586.283	4'336.283
Zurückgenommene Anteile		-	-750.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'586.283	3'586.283
Klasse NT CHF	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		846'982.617	700'809.798
Ausgegebene Anteile		37'181.739	162'620.029
Zurückgenommene Anteile		-107'604.564	-16'447.210
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		776'559.792	846'982.617
Klasse ST CHF	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		448.269	401.991
Ausgegebene Anteile		26.546	82.925
Zurückgenommene Anteile		-17.596	-36.647
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		457.219	448.269

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		107'426'796.35	94'375'339.45
Ausbezahlte Ausschüttung		-9'862.28	-11'491.96
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-1'403'535.52	-1'259'928.79
Saldo aus dem Anteilverkehr		-4'779'924.81	15'475'779.20
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'753'524.01	-1'152'901.55
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		102'986'997.75	107'426'796.35

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.02.2024 31.07.2024	01.02.2023 31.01.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'255.34	2'052.75
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		2'022'878.49	4'050'888.10
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		63'628.15	335'990.17
Total Ertrag		2'087'761.98	4'388'931.02
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-40.42
Reglementarische Vergütungen		-389.28	-904.11
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-11'706.77	-127'290.43
Total Aufwand		-12'096.05	-128'234.96
Nettoertrag / Verlust		2'075'665.93	4'260'696.06
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'121'826.33	-3'023'319.22
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		25'605.80	61'195.75
Realisierter Erfolg		979'445.40	1'298'572.59
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		774'078.61	-2'451'474.14
Gesamterfolg		1'753'524.01	-1'152'901.55

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 CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							101'417'716.43	98.48	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte							101'417'716.43	98.48	
DK0009922320	4.5000 % DGB 4 1/2 11/15/39	14'415	200	308	14'307 DKK	125.27%	2'287'667.58	2.22	a)
DK0009923138	1.7500 % DGB 1 3/4 11/15/25	8'655	600	0	9'255 DKK	98.83%	1'167'562.90	1.13	a)
DK0009923567	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/27	9'550	0	1'375	8'175 DKK	94.54%	986'548.47	0.96	a)
DK0009923807	0.5000 % DGB 0 1/2 11/15/29	7'730	0	430	7'300 DKK	91.65%	854'025.57	0.83	a)
DK0009924029	0.2500 % DGB 0 1/4 11/15/52	8'435	250	0	8'685 DKK	55.19%	611'861.54	0.59	a)
DK0009924102	0.0000 % DGB 0 11/15/31 TWIN	9'225	0	775	8'450 DKK	85.40%	921'105.35	0.89	a)
DK0009924532	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/33 TWIN	5'390	1'460	0	6'850 DKK	99.48%	869'844.09	0.84	a)
DK0009924888	2.2500 % DGB 2 1/4 11/15/26	0	2'650	0	2'650 DKK	99.42%	336'306.07	0.33	a)
DKK							8'034'921.57	7.80	
IL0010994569	6.2500 % ILGOV 6 1/4 10/30/26 1026	1'988	0	0	1'988 ILS	104.17%	484'646.92	0.47	a)
IL0011254005	5.5000 % ILGOV 5 1/2 01/31/42 0142	2'642	0	0	2'642 ILS	103.27%	638'514.02	0.62	a)
IL0011355570	1.7500 % ILGOV 1 3/4 08/31/25 0825	3'288	0	0	3'288 ILS	97.53%	750'517.75	0.73	a)
IL0011393449	2.0000 % ILGOV 2 03/31/27 0327	3'620	0	0	3'620 ILS	94.26%	798'577.00	0.78	a)
IL0011401937	3.7500 % ILGOV 3 3/4 03/31/47 0347	3'489	300	0	3'789 ILS	79.60%	705'818.19	0.69	a)
IL0011508798	2.2500 % ILGOV 2 1/4 09/28/28 0928	3'751	650	0	4'401 ILS	91.57%	943'104.35	0.92	a)
IL0011609851	1.0000 % ILGOV 1 03/31/30 0330	5'731	0	0	5'731 ILS	82.08%	1'100'756.77	1.07	a)
IL0011626681	0.5000 % ILGOV 0 1/2 04/30/25 0425	3'110	0	3'110	0 ILS	0.00%	0.00	0.00	
IL0011661803	1.5000 % ILGOV 1 1/2 05/31/37 0537	3'930	300	0	4'230 ILS	67.12%	664'449.15	0.65	a)
IL0011746976	0.5000 % ILGOV 0 1/2 02/27/26 0226	4'052	0	0	4'052 ILS	94.46%	895'729.79	0.87	a)
IL0011806606	1.3000 % ILGOV 1.3 04/30/32 0432	3'312	775	0	4'087 ILS	77.77%	743'867.00	0.72	a)
IL0011840761	2.8000 % ILGOV 2.8 11/29/52 1152	1'730	630	0	2'360 ILS	62.82%	346'953.65	0.34	a)
IL0011948028	3.7500 % ILGOV 3 3/4 02/28/29 0229	1'949	1'250	0	3'199 ILS	96.78%	724'486.77	0.70	a)
IL0012023326	4.0000 % ILGOV 4 03/30/35 0335	0	1'700	0	1'700 ILS	92.57%	368'304.60	0.36	a)
IL0012035791	3.7500 % ILGOV 3 3/4 09/30/27 0927	0	1'800	0	1'800 ILS	98.17%	413'554.74	0.40	a)
ILS							9'579'280.70	9.30	
MX0MGO0000B2	10.0000 % MBONO 10 11/20/36 M	101'230	0	0	101'230 MXN	101.65%	486'175.99	0.47	a)
MX0MGO0000D8	7.5000 % MBONO 7 1/2 06/03/27 M	486'670	0	5'000	481'670 MXN	94.17%	2'143'213.04	2.08	a)
MX0MGO0000H9	8.5000 % MBONO 8 1/2 05/31/29 M	397'410	11'000	0	408'410 MXN	95.14%	1'835'907.25	1.78	a)
MX0MGO0000J5	8.5000 % MBONO 8 1/2 11/18/38 M	295'040	0	0	295'040 MXN	89.42%	1'246'566.70	1.21	a)
MX0MGO0000P2	7.7500 % MBONO 7 3/4 05/29/31 M	585'942	0	19'000	566'942 MXN	90.08%	2'412'931.21	2.34	a)
MX0MGO0000R8	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/13/42 M	444'776	50'200	5'000	489'976 MXN	81.27%	1'881'409.16	1.83	a)
MX0MGO0000U2	7.7500 % MBONO 7 3/4 11/23/34 M	147'290	107'500	0	254'790 MXN	86.96%	1'046'803.29	1.02	a)
MX0MGO0000Y4	5.7500 % MBONO 5 3/4 03/05/26 M	611'250	0	10'000	601'250 MXN	93.06%	2'643'542.46	2.57	a)
MX0MGO000102	8.0000 % MBONO 8 11/07/47 M	359'450	0	0	359'450 MXN	82.05%	1'393'551.17	1.35	a)
MX0MGO000193	7.0000 % MBONO 7 09/03/26 M	202'000	88'000	0	290'000 MXN	93.73%	1'284'270.18	1.25	a)
MX0MGO0001B0	5.0000 % MBONO 5 03/06/25 M	194'500	0	194'500	0 MXN	0.00%	0.00	0.00	
MX0MGO0001C8	5.5000 % MBONO 5 1/2 03/04/27 M	501'950	20'000	0	521'950 MXN	89.97%	2'218'800.27	2.15	a)
MX0MGO0001D6	7.5000 % MBONO 7 1/2 05/26/33 M	386'900	45'000	0	431'900 MXN	86.64%	1'768'105.44	1.72	a)
MX0MGO0001E4	8.0000 % MBONO 8 07/31/53 M	295'250	104'650	0	399'900 MXN	81.24%	1'534'903.06	1.49	a)
MX0MGO0001F1	8.5000 % MBONO 8 1/2 03/01/29 M	121'270	163'000	0	284'270 MXN	95.19%	1'278'445.40	1.24	a)
MXMSG0000001	8.0000 % MBONO 8 05/24/35 MS	31'800	0	0	31'800 MXN	86.96%	130'652.65	0.13	a)
MXN							23'305'277.27	22.63	
MYBMI2300024	3.5190 % MGS 3.519 04/20/28 0223	2'291	0	400	1'891 MYR	100.29%	363'343.12	0.35	a)
MYBMK1800012	3.8820 % MGS 3.882 03/14/25 0118	2'500	0	2'500	0 MYR	0.00%	0.00	0.00	
MYBMK2200030	4.5040 % MGS 4.504 04/30/29 0322	1'600	0	400	1'200 MYR	104.14%	239'428.00	0.23	a)
MYBML1900018	3.9060 % MGS 3.906 07/15/26 0119	2'870	0	0	2'870 MYR	101.18%	556'339.71	0.54	a)
MYBMO1500010	3.9550 % MGS 3.955 09/15/25 0115	4'300	0	540	3'760 MYR	100.82%	726'248.23	0.71	a)
MYBMO1600034	3.9000 % MGS 3.9 11/30/26 0316	3'300	0	0	3'300 MYR	101.37%	640'920.29	0.62	a)
MYBMO1700040	3.8990 % MGS 3.899 11/16/27 0417	3'550	0	0	3'550 MYR	101.57%	690'794.32	0.67	a)
MYBMO1900020	3.8850 % MGS 3.885 08/15/29 0219	3'000	600	0	3'600 MYR	101.58%	700'606.59	0.68	a)
MYBMO2000028	2.6320 % MGS 2.632 04/15/31 0220	2'700	1'400	0	4'100 MYR	93.81%	736'886.80	0.72	a)
MYBMO2200016	3.5820 % MGS 3.582 07/15/32 0122	2'900	0	620	2'280 MYR	98.92%	432'119.93	0.42	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 CHF	in % 7)	Kat.
MYBMS1100036	4.3920 % MGS 4.392 04/15/26 0311	1'750	0	580	1'170 MYR	101.84%	228'291.16	0.22	a)
MYBMS1200026	3.8920 % MGS 3.892 03/15/27 0212	1'000	0	500	500 MYR	101.24%	96'980.77	0.09	a)
MYBMS1300057	3.7330 % MGS 3.733 06/15/28 0513	3'750	0	430	3'320 MYR	100.88%	641'681.55	0.62	a)
MYBMS1900047	3.8280 % MGS 3.828 07/05/34 0419	2'900	0	340	2'560 MYR	100.96%	495'148.63	0.48	a)
MYBMS2400013	4.0540 % MGS 4.054 04/18/39 0124	0	600	0	600 MYR	101.90%	117'141.36	0.11	a)
MYBMT1800039	4.6420 % MGS 4.642 11/07/33 0318	3'055	850	400	3'505 MYR	107.16%	719'568.76	0.70	a)
MYBMX0700034	3.5020 % MGS 3.502 05/31/27 0307	2'400	900	0	3'300 MYR	100.35%	634'446.16	0.62	a)
MYBMX1000038	4.4980 % MGS 4.498 04/15/30 0310	4'490	0	650	3'840 MYR	104.44%	768'339.91	0.75	a)
MYBMX1100044	4.2320 % MGS 4.232 06/30/31 0411	2'130	0	250	1'880 MYR	103.29%	372'045.90	0.36	a)
MYBMX1300040	3.8440 % MGS 3.844 04/15/33 0413	2'050	0	0	2'050 MYR	100.53%	394'824.75	0.38	a)
MYBMX1700033	4.7620 % MGS 4.762 04/07/37 0317	4'230	0	750	3'480 MYR	108.84%	725'683.97	0.70	a)
MYBMX1800049	4.8930 % MGS 4.893 06/08/38 0418	3'400	0	0	3'400 MYR	110.24%	718'101.62	0.70	a)
MYBMX2400021	4.1800 % MGS 4.18 05/16/44 0224	0	650	0	650 MYR	102.14%	127'197.04	0.12	a)
MYBMY1500043	4.2540 % MGS 4.254 05/31/35 0415	2'550	0	320	2'230 MYR	103.84%	443'633.95	0.43	a)
MYBMY1900052	3.7570 % MGS 3.757 05/22/40 0519	3'970	0	550	3'420 MYR	97.46%	638'587.33	0.62	a)
MYBMY2200023	4.6960 % MGS 4.696 10/15/42 0222	3'710	0	450	3'260 MYR	108.59%	678'239.71	0.66	a)
MYBMZ1300078	4.9350 % MGS 4.935 09/30/43 0713	1'270	0	0	1'270 MYR	111.10%	270'317.30	0.26	a)
MYBMZ1600022	4.7360 % MGS 4.736 03/15/46 0216	1'900	0	340	1'560 MYR	108.78%	325'118.31	0.32	a)
MYBMZ1800051	4.9210 % MGS 4.921 07/06/48 0518	2'530	0	250	2'280 MYR	111.99%	489'190.48	0.48	a)
MYBMZ2000016	4.0650 % MGS 4.065 06/15/50 0120	4'410	0	560	3'850 MYR	98.78%	728'628.79	0.71	a)
MYBMZ2300010	4.4570 % MGS 4.457 03/31/53 0123	1'600	600	0	2'200 MYR	104.99%	442'525.60	0.43	a)
MYR							15'142'380.04	14.70	
NO0010732555	1.7500 % NGB 1 3/4 03/13/25 477	8'350	0	8'350	0 NOK	0.00%	0.00	0.00	
NO0010757925	1.5000 % NGB 1 1/2 02/19/26 478	7'050	500	0	7'550 NOK	96.55%	586'828.00	0.57	a)
NO0010786288	1.7500 % NGB 1 3/4 02/17/27 479	6'965	250	0	7'215 NOK	95.78%	556'311.80	0.54	a)
NO0010821598	2.0000 % NGB 2 04/26/28 480	5'810	200	0	6'010 NOK	95.12%	460'207.21	0.45	a)
NO0010844079	1.7500 % NGB 1 3/4 09/06/29 481	5'810	0	0	5'810 NOK	92.31%	431'749.64	0.42	a)
NO0010875230	1.3750 % NGB 1 3/8 08/19/30 482	7'683	0	0	7'683 NOK	88.98%	550'357.61	0.53	a)
NO0010930522	1.2500 % NGB 1 1/4 09/17/31 483	6'040	210	0	6'250 NOK	86.39%	434'665.95	0.42	a)
NO0012440397	2.1250 % NGB 2 1/8 05/18/32 484	5'890	350	0	6'240 NOK	91.11%	457'670.55	0.44	a)
NO0012712506	3.5000 % NGB 3 1/2 10/06/42 485	3'000	0	0	3'000 NOK	100.79%	243'411.72	0.24	a)
NO0012837642	3.0000 % NGB 3 08/15/33 486	6'830	1'000	0	7'830 NOK	96.40%	607'664.57	0.59	a)
NO0013148338	3.6250 % NGB 3 5/8 04/13/34 487	0	4'900	0	4'900 NOK	101.19%	399'146.38	0.39	a)
NOK							4'728'013.43	4.59	
NZGOVDT425C5	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/25 0425	1'175	0	1'175	0 NZD	0.00%	0.00	0.00	
NZGOVDT427C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 04/15/27 0427	1'320	90	0	1'410 NZD	100.97%	744'313.30	0.72	a)
NZGOVDT429C7	3.0000 % NZGB 3 04/20/29 0429	1'195	265	0	1'460 NZD	95.53%	729'227.23	0.71	a)
NZGOVDT433C9	3.5000 % NZGB 3 1/2 04/14/33 0433	1'860	150	0	2'010 NZD	94.12%	989'126.31	0.96	a)
NZGOVDT437C0	2.7500 % NZGB 2 3/4 04/15/37 0437	935	50	0	985 NZD	82.56%	425'173.10	0.41	a)
NZGOVDT526C0	0.5000 % NZGB 0 1/2 05/15/26 0526	1'130	0	0	1'130 NZD	93.44%	552'049.39	0.54	a)
NZGOVDT528C6	0.2500 % NZGB 0 1/4 05/15/28 0528	1'360	580	50	1'890 NZD	86.84%	858'061.84	0.83	a)
NZGOVDT530C2	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/30 0530	776	175	0	951 NZD	102.11%	507'680.73	0.49	a)
NZGOVDT531C0	1.5000 % NZGB 1 1/2 05/15/31 0531	1'100	100	0	1'200 NZD	84.38%	529'417.52	0.51	a)
NZGOVDT532C8	2.0000 % NZGB 2 05/15/32 0532	1'130	200	0	1'330 NZD	85.10%	591'776.53	0.57	a)
NZGOVDT534C4	4.2500 % NZGB 4 1/4 05/15/34 0534	685	280	0	965 NZD	99.16%	500'263.00	0.49	a)
NZGOVDT535C1	4.5000 % NZGB 4 1/2 05/15/35 0535	0	600	0	600 NZD	100.64%	315'717.77	0.31	a)
NZGOVDT541C9	1.7500 % NZGB 1 3/4 05/15/41 0541	707	0	0	707 NZD	65.54%	242'263.95	0.24	a)
NZGOVDT551C8	2.7500 % NZGB 2 3/4 05/15/51 0551	910	50	25	935 NZD	69.24%	338'474.71	0.33	a)
NZGOVDT554C2	5.0000 % NZGB 5 05/15/54 0554	0	545	0	545 NZD	102.69%	292'618.32	0.28	a)
NZD							7'616'163.70	7.40	
PL0000105391	5.7500 % POLGB 5 3/4 04/25/29 0429	226	0	0	226 PLN	102.31%	51'287.51	0.05	a)
PL0000107611	2.7500 % POLGB 2 3/4 04/25/28 0428	15'526	1'720	0	17'246 PLN	92.17%	3'525'843.94	3.42	a)
PL0000108197	3.2500 % POLGB 3 1/4 07/25/25 0725	3'852	4'465	8'317	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000108866	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/26 0726	5'315	400	0	5'715 PLN	95.47%	1'210'231.00	1.18	a)
PL0000109427	2.5000 % POLGB 2 1/2 07/25/27 0727	4'998	400	0	5'398 PLN	93.06%	1'114'245.90	1.08	a)
PL0000111498	2.7500 % POLGB 2 3/4 10/25/29 1029	9'100	2'500	0	11'600 PLN	89.13%	2'293'332.43	2.23	a)
PL0000112728	0.7500 % POLGB 0 3/4 04/25/25 0425	5'674	0	5'674	0 PLN	0.00%	0.00	0.00	
PL0000112736	1.2500 % POLGB 1 1/4 10/25/30 1030	5'721	750	0	6'471 PLN	79.23%	1'137'224.41	1.10	a)
PL0000113460	0.2500 % POLGB 0 1/4 10/25/26 1026	8'655	0	0	8'655 PLN	90.12%	1'730'108.63	1.68	a)
PL0000113783	1.7500 % POLGB 1 3/4 04/25/32 0432	12'509	4'300	0	16'809 PLN	77.93%	2'905'572.19	2.82	a)
PL0000114393	3.7500 % POLGB 3 3/4 05/25/27 0527	1'350	0	0	1'350 PLN	96.63%	289'354.92	0.28	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 CHF	in % 7)	Kat.
PL0000115283	0.0000 % POLGB 0 10/25/25 1025	3'900	0	450	3'450 PLN	94.63%	724'157.53	0.70	a)
PL0000116596	0.0000 % POLGB 0 04/25/26 0426	0	2'200	0	2'200 PLN	92.04%	449'142.76	0.44	a)
PL0000116760	4.7500 % POLGB 4 3/4 07/25/29 0729	0	2'000	0	2'000 PLN	97.88%	434'219.25	0.42	a)
PLN							15'864'720.47	15.40	
SE0002829192	3.5000 % SGB 3 1/2 03/30/39 #1053 1053	5'980	175	205	5'950 SEK	116.76%	570'583.93	0.55	a)
SE0004517290	2.2500 % SGB 2 1/4 06/01/32 #1056 1056	6'820	300	585	6'535 SEK	102.05%	547'714.60	0.53	a)
SE0005676608	2.5000 % SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 1058	11'270	0	11'270	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0007125927	1.0000 % SGB 1 11/12/26 #1059 1059	11'605	0	245	11'360 SEK	97.44%	909'144.69	0.88	a)
SE0009496367	0.7500 % SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 1060	10'375	0	0	10'375 SEK	95.59%	814'550.73	0.79	a)
SE0011281922	0.7500 % SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 1061	9'455	695	255	9'895 SEK	94.12%	764'910.84	0.74	a)
SE0013935319	0.1250 % SGB 0 1/8 05/12/31 #1062 1062	7'765	0	0	7'765 SEK	88.51%	564'446.34	0.55	a)
SE0017830730	1.7500 % SGB 1 3/4 11/11/33 #1065 1065	7'050	1'400	615	7'835 SEK	97.76%	629'071.19	0.61	a)
SEK							4'800'422.32	4.66	
SG31A0000001	2.3750 % SIGB 2 3/8 06/01/25	1'432	0	1'432	0 SGD	0.00%	0.00	0.00	
SG31A7000004	2.7500 % SIGB 2 3/4 03/01/46	939	265	20	1'184 SGD	97.66%	760'936.12	0.74	a)
SG31A8000003	2.1250 % SIGB 2 1/8 06/01/26	1'080	375	0	1'455 SGD	98.41%	942'284.40	0.91	a)
SG31A9000002	2.2500 % SIGB 2 1/4 08/01/36	1'163	0	25	1'138 SGD	93.57%	700'742.84	0.68	a)
SG31B7000002	2.6250 % SIGB 2 5/8 05/01/28	935	0	0	935 SGD	99.15%	610'076.23	0.59	a)
SG3254976487	2.7500 % SIGB 2 3/4 04/01/42	913	0	0	913 SGD	97.87%	588'030.89	0.57	a)
SG3261987691	3.3750 % SIGB 3 3/8 09/01/33	1'188	0	0	1'188 SGD	103.95%	812'682.13	0.79	a)
SG3263998209	2.8750 % SIGB 2 7/8 07/01/29	957	0	25	932 SGD	100.19%	614'497.42	0.60	a)
SG7J60932174	3.5000 % SIGB 3 1/2 03/01/27	1'270	0	0	1'270 SGD	101.47%	848'049.41	0.82	a)
SG7U32949426	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/30	1'202	0	25	1'177 SGD	100.19%	776'033.76	0.75	a)
SGXF12888537	1.2500 % SIGB 1 1/4 11/01/26	884	350	0	1'234 SGD	96.34%	782'350.88	0.76	a)
SGXF13029610	2.3750 % SIGB 2 3/8 07/01/39	621	0	0	621 SGD	93.64%	382'677.37	0.37	a)
SGXF27246101	1.8750 % SIGB 1 7/8 03/01/50	926	0	0	926 SGD	81.84%	498'719.54	0.48	a)
SGXF29144064	0.5000 % SIGB 0 1/2 11/01/25	1'026	0	0	1'026 SGD	96.62%	652'370.28	0.63	a)
SGXF33080817	2.8750 % SIGB 2 7/8 09/01/27	433	200	0	633 SGD	99.97%	416'440.71	0.40	a)
SGXF45447632	3.0000 % SIGB 3 04/01/29	0	350	0	350 SGD	100.85%	232'286.37	0.23	a)
SGXF46767848	2.6250 % SIGB 2 5/8 08/01/32	775	0	0	775 SGD	98.22%	500'935.03	0.49	a)
SGXF47639806	3.0000 % SIGB 3 08/01/2072	718	0	0	718 SGD	102.78%	485'638.19	0.47	a)
SGXF51035222	2.8750 % SIGB 2 7/8 08/01/28	330	200	0	530 SGD	100.20%	349'480.84	0.34	a)
SGXF75438295	3.3750 % SIGB 3 3/8 05/01/34	0	355	0	355 SGD	104.19%	243'407.62	0.24	a)
SGXF76205099	1.6250 % SIGB 1 5/8 07/01/31	777	0	0	777 SGD	92.19%	471'394.61	0.46	a)
SGXF89085702	1.8750 % SIGB 1 7/8 10/01/51	830	0	20	810 SGD	80.71%	430'221.53	0.42	a)
SGXPK17B11U8	3.2500 % SIGB 3 1/4 06/01/54	0	350	0	350 SGD	107.36%	247'280.76	0.24	a)
SGD							12'346'536.93	11.99	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte									
	USD/SGD Verfall 03.04.2024		55'327	41'000	SGD/USD		0.00	0.00	
	MXN/USD Verfall 08.05.2024		220'000	3'728'714	USD/MXN		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 08.05.2024		60'000	89'233	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 08.05.2024		85'000	1'015'689	CHF/SEK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 08.05.2024		50'000	204'024	CHF/ILS		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 08.05.2024		100'000	763'936	CHF/DKK		0.00	0.00	
	PLN/CHF Verfall 08.05.2024		160'000	710'338	CHF/PLN		0.00	0.00	
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
Vermögensaufstellung							Kurswert CHF	in % 7)	
	Bankguthaben auf Sicht						384'018.53	0.37	
	Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte						101'417'716.43	98.48	
	Sonstige Vermögenswerte						1'185'331.71	1.15	
	Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode						102'987'066.67	100.00	
	Andere Verbindlichkeiten						-68.92		
	Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode						102'986'997.75		

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);	101'417'716.43	98.48
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

DKK	100 = CHF	12.76483100
ILS	1 = CHF	0.23403124
MXN	1 = CHF	0.04724779
MYR	1 = CHF	0.19158777
NOK	100 = CHF	8.05020800
NZD	1 = CHF	0.52282449
PLN	1 = CHF	0.22181204
SEK	100 = CHF	8.21312600
SGD	1 = CHF	0.65808164
USD	1 = CHF	0.88025000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

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

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 CHF	CHF	0.00 - 0.28	-	0.280	0.00 - 0.10	-	0.100
NT CHF	CHF	0.00 - 0.28	-	0.280	0.00 - 0.10	-	0.100
ST CHF	CHF	0.00 - 0.28	-	0.280	0.00 - 0.10	-	0.100

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

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.02.2024 - 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 CHF	0.290	0.500	0.190	0.100	-
NT CHF	-	-	-	-	-
ST CHF	-	-	-	-	-

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

8 Benchmark

FTSE Non-AUD Non-CAD Non-CHF Non-CNY Non-EMU Non-GBP Non-JPY Non-USD World Government Bond Index TR

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 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.