

# SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND SWITZERLAND TOTAL (I)

## Halbjahresbericht per 31.08.2024

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
DT CHF	11704371	CHF
FA CHF	31562299	CHF
GT CHF	33096859	CHF
MT CHF	51788856	CHF
NT CHF	11704370	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	13
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
8	Pauschale Verwaltungskommission	15
9	Benchmark	15
10	TER	15
11	Fussnoten	16
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17

# 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	01.03.2024	01.03.2023	01.03.2022	01.03.2021
	bis	31.08.2024	29.02.2024	28.02.2023	28.02.2022
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'861'681'362.88	4'198'308'790.84	3'948'405'426.48	4'080'406'529.44
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		28'651'476.77	38'658'609.85	31'759'165.31	25'072'516.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		113'861.560	169'081.072	142'836.376	105'341.406
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		251.6343	228.6395	222.3465	238.0120
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		267.9374	239.9449	223.6987	230.9711
Thesaurierung je Anteil		-	6.01	5.54	5.00
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.15 %	0.15 %
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		79'481'902.22	65'224'374.12	40'515'924.23	37'707'077.60
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		494'432.619	438'556.798	275'631.628	235'864.871
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		160.7538	148.7250	146.9930	159.8673
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		171.1688	156.0789	147.8870	155.1381
Ausschüttung je Anteil		-	4.00	3.70	3.40
Kapitalausschüttung je Anteil		-	0.20	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.15 %	0.15 %
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		156'933'598.19	807'674'706.15	884'458'366.82	1'046'968'800.78
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		897'107.847	5'081'499.732	5'722'457.541	6'328'440.467
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		174.9328	158.9442	154.5592	165.4387
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		186.2665	166.8034	155.4992	160.5447
Thesaurierung je Anteil		-	4.19	3.87	3.49
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse MT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		98'979'989.41	82'971'685.77	53'911'228.29	23'829'967.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		809'614.249	747'137.141	499'692.573	206'548.644
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		122.2557	111.0528	107.8888	115.3722
Thesaurierung je Anteil		-	3.08	2.85	2.60
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'497'634'396.29	3'203'779'414.95	2'937'760'741.83	2'946'828'167.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'645'438.899	13'759'911.296	12'987'408.399	12'181'129.256
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		256.3226	232.8343	226.2007	241.9175
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		272.9294	244.3471	227.5764	234.7611
Thesaurierung je Anteil		-	6.46	5.98	5.45
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 DT CHF	11.01 %	5.92 %	-16.56 %	23.20 %
Klasse FA CHF	11.00 %	5.93 %	-16.57 %	23.20 %
Klasse GT CHF	11.01 %	5.93 %	-16.55 %	23.21 %
Klasse MT CHF	11.09 %	6.08 %	-16.43 %	23.38 %
Klasse NT CHF	11.09 %	6.08 %	-16.44 %	23.38 %
Benchmark	11.08 %	6.09 %	-16.48 %	23.38 %
Tracking Error 33)	-	0.02 %	0.03 %	0.03 %

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 DT CHF	-0.07 %
Klasse FA CHF	-0.08 %
Klasse GT CHF	-0.07 %
Klasse MT CHF	0.01 %
Klasse NT CHF	0.01 %

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)	31.08.2024	29.02.2024
Bankguthaben auf Sicht	4'789'509.18	10'574'659.80
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	3'817'545'975.01	4'176'200'304.05
Sonstige Vermögenswerte	39'376'366.71	11'634'645.34
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'861'711'850.90</b>	<b>4'198'409'609.19</b>
Andere Verbindlichkeiten	-30'488.02	-100'818.35
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'861'681'362.88</b>	<b>4'198'308'790.84</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Klasse DT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		169'081.072	142'836.376
Ausgegebene Anteile		17'617.990	35'792.091
Zurückgenommene Anteile		-72'837.502	-9'547.395
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>113'861.560</b>	<b>169'081.072</b>
<b>Klasse FA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		438'556.798	275'631.628
Ausgegebene Anteile		99'828.528	187'109.761
Zurückgenommene Anteile		-43'952.707	-24'184.591
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>494'432.619</b>	<b>438'556.798</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'081'499.732	5'722'457.541
Ausgegebene Anteile		803'767.731	1'920'459.540
Zurückgenommene Anteile		-4'988'159.616	-2'561'417.349
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>897'107.847</b>	<b>5'081'499.732</b>
<b>Klasse MT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		747'137.141	499'692.573
Ausgegebene Anteile		81'664.350	247'444.568
Zurückgenommene Anteile		-19'187.242	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>809'614.249</b>	<b>747'137.141</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		13'759'911.296	12'987'408.399
Ausgegebene Anteile		669'849.464	2'135'550.014
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		41'104.500	86'747.656
Zurückgenommene Anteile		-825'426.361	-1'449'794.773
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>13'645'438.899</b>	<b>13'759'911.296</b>

## Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	20.03.2024	9'823'358.93	41'104.500

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		4'198'308'790.84	3'948'405'426.48
Ausbezahlte Ausschüttung		-2'061'323.99	-1'231'042.62
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-39'223'125.58	-36'807'866.49
Saldo aus dem Anteilverkehr		-720'137'477.41	125'785'535.97
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		424'794'499.02	162'156'737.50
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>3'861'681'362.88</b>	<b>4'198'308'790.84</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.03.2024 31.08.2024</b>	<b>01.03.2023 29.02.2024</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		31'083.24	50'825.34
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		112'643'618.93	114'806'392.80
Erträge der Gratisaktien		0.00	8'697.00
Erträge aus Wertpapierleihe		179'069.50	626'322.55
Sonstige Erträge		0.00	-21.25
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		6'927'887.52	20'361'157.89
<b>Total Ertrag</b>		<b>119'781'659.19</b>	<b>135'853'374.33</b>
<b>Aufwand</b>			
Reglementarische Vergütungen		-485'317.08	-1'406'447.62
Sonstige Aufwendungen		-682.90	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-24'829'135.48	-19'101'480.30
<b>Total Aufwand</b>		<b>-25'315'135.46</b>	<b>-20'507'927.92</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>94'466'523.73</b>	<b>115'345'446.41</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		127'562'872.17	48'549'046.24
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		11'477'183.86	8'943'502.89
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		234'364.84	248'516.89
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>233'740'944.60</b>	<b>173'086'512.43</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		191'053'554.42	-10'929'774.93
<b>Gesamterfolg</b>		<b>424'794'499.02</b>	<b>162'156'737.50</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>3'817'544'598.97</b>	<b>98.86</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>3'817'544'598.97</b>	<b>98.86</b>	
AT0000A18XM4	AMS-OSRAM AG	2'774'728	399'927	816'261	2'358'394	CHF 1.04	2'462'163.34	0.06	a)
AT0000KTMIO2	PIERER MOBILITY AG	25'891	0	0	25'891	CHF 25.60	662'809.60	0.02	a)
<b>AT</b>							<b>3'124'972.94</b>	<b>0.08</b>	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	557'680	40'900	148'928	449'652	CHF 4.81	2'161'027.51	0.06	a)
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	224	0	0	224	CHF 3'600.00	806'400.00	0.02	a)
CH0001340204	GRAUBUENDNER KANTONALBANK-PC	1'931	0	0	1'931	CHF 1'700.00	3'282'700.00	0.09	a)
CH0001341608	HYPOTHEKARBANK LENZBURG-REG	70	0	0	70	CHF 4'060.00	284'200.00	0.01	a)
CH0001473559	BASELLANDS KANTONALBANK-CERT	2'037	0	0	2'037	CHF 852.00	1'735'524.00	0.04	a)
CH0001624714	CPH GROUP AG	1'932	0	0	1'932	CHF 66.00	127'512.00	0.00	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	159'197	6'067	31'026	134'238	CHF 27.95	3'751'952.10	0.10	a)
CH0002277314	SCHLATTER INDUSTRIES AG	374	0	0	374	CHF 21.60	8'078.40	0.00	a)
CH0002361068	STARRAGTORNOS GROUP AG	3'666	0	0	3'666	CHF 46.60	170'835.60	0.00	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	17'769	1'707	4'461	15'015	CHF 356.50	5'352'847.50	0.14	a)
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	544	136	109	571	CHF 1'710.00	976'410.00	0.03	a)
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	2'982	4'447	0	7'429	CHF 18.65	138'550.85	0.00	a)
CH0003420806	ORELL FUJESSLI HOLDING AG-REG	1'305	0	0	1'305	CHF 78.00	101'790.00	0.00	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	2'829	115	478	2'466	CHF 880.00	2'170'080.00	0.06	a)
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	7'868	1'294	2'782	6'380	CHF 101.40	646'932.00	0.02	a)
CH0005319162	ELMA ELECTRONIC AG-REG	19	0	19	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	1'926'411	0	1'926'411	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0006089921	PRIVATE EQUITY HLDG-REG	10'070	0	0	10'070	CHF 74.00	745'180.00	0.02	a)
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	2'134	31	360	1'805	CHF 2'520.00	4'548'600.00	0.12	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	209'441	19'146	48'500	180'087	CHF 95.60	17'216'317.20	0.45	a)
CH0008207356	BVZ HOLDING AG-REG NEW	162	0	0	162	CHF 925.00	149'850.00	0.00	a)
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	4'183	0	0	4'183	CHF 51.20	214'169.60	0.01	a)
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	70'190	4'027	15'087	59'130	CHF 536.50	31'723'245.00	0.82	a)
CH0008837566	ALLREAL HOLDING AG-REG	45'705	6'273	13'591	38'387	CHF 161.00	6'180'307.00	0.16	a)
CH0008967926	ADVAL TECH HOLDING AG-REG	33	0	0	33	CHF 85.00	2'805.00	0.00	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	9'738	629	2'056	8'311	CHF 1'376.00	11'435'936.00	0.30	a)
CH0009236461	BASLER KANTONALBK - PC	19'560	0	0	19'560	CHF 65.40	1'279'224.00	0.03	a)
CH0009320091	FEINTOOL INTL HOLDING-REG	18'708	0	0	18'708	CHF 15.90	297'457.20	0.01	a)
CH0009691608	BERNER KANTONALBANK AG-REG	12'919	0	0	12'919	CHF 230.00	2'971'370.00	0.08	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	297	41	74	264	CHF 111'000.00	29'304'000.00	0.76	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2'795	190	566	2'419	CHF 11'220.00	27'141'180.00	0.70	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	21'938	1'242	4'601	18'579	CHF 4'356.00	80'930'124.00	2.10	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	30'508	1'617	6'220	25'905	CHF 303.40	7'859'577.00	0.20	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	11'513	1'735	4'166	9'082	CHF 132.20	1'200'640.40	0.03	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	4'872	257	1'071	4'058	CHF 1'214.00	4'926'412.00	0.13	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	403'147	24'364	86'461	341'050	CHF 491.40	167'591'970.00	4.34	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	21'123	1'892	6'336	16'679	CHF 269.50	4'494'990.50	0.12	a)
CH0011178255	TX GROUP AG	9'110	1'171	2'373	7'908	CHF 146.40	1'157'731.20	0.03	a)
CH0011339204	ASCOM HOLDING AG-REG	117'848	0	0	117'848	CHF 5.60	659'948.80	0.02	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	39'935	0	10'753	29'182	CHF 46.00	1'342'372.00	0.03	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	9'177	383	3'817	5'743	CHF 418.00	2'400'574.00	0.06	a)
CH0011795959	DORMAKABA HOLDING AG	8'855	193	2'040	7'008	CHF 531.00	3'721'248.00	0.10	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	5'825'102	328'635	1'378'180	4'775'557	CHF 102.12	487'679'880.84	12.63	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	1'935'671	111'086	405'639	1'641'118	CHF 287.20	471'329'089.60	12.21	a)
CH0012032113	ROCHE HOLDING AG-BR	81'085	2'816	15'672	68'229	CHF 308.40	21'041'823.60	0.54	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	35'036	3'062	7'953	30'145	CHF 285.00	8'591'325.00	0.22	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	460'916	18'536	87'272	392'180	CHF 28.84	11'310'471.20	0.29	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	620'882	48'532	138'206	531'208	CHF 13.34	7'086'314.72	0.18	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	1'463'525	116'585	313'317	1'266'793	CHF 81.72	103'522'323.96	2.68	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	4'447'940	250'846	971'511	3'727'275	CHF 48.63	181'257'383.25	4.69	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	153'965	8'203	35'817	126'351	CHF 35.40	4'472'825.40	0.12	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	79'185	4'751	16'079	67'857	CHF 177.80	12'064'974.60	0.31	a)
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	115'126	0	0	115'126	CHF 1.41	162'327.66	0.00	a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	77'911	666	17'725	60'852	CHF 55.80	3'395'541.60	0.09	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	125'705	8'197	28'667	105'235	CHF 164.10	17'269'063.50	0.45	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	178'856	12'758	42'945	148'669	CHF 59.10	8'786'337.90	0.23	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	135'555	6'907	27'298	115'164	CHF 295.80	34'065'511.20	0.88	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	6'022	673	1'885	4'810	CHF 883.00	4'247'230.00	0.11	a)
CH0013396012	SKAN GROUP AG	35'783	3'078	10'038	28'823	CHF 81.00	2'334'663.00	0.06	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	204'803	12'505	43'319	173'989	CHF 555.60	96'668'288.40	2.50	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	11'291	1'230	2'448	10'073	CHF 1'118.00	11'261'614.00	0.29	a)
CH0014345117	COMPAGNIE FINANCIERE TRAD-BR	4'779	0	0	4'779	CHF 149.00	712'071.00	0.02	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	50'535	2'730	18'204	35'061	CHF 98.70	3'460'520.70	0.09	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	81'165	4'568	17'040	68'693	CHF 686.00	47'123'398.00	1.22	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	18'309	1'174	3'696	15'787	CHF 711.50	11'232'450.50	0.29	a)
CH0017875789	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG	14'194	239	261	14'172	CHF 201.50	2'855'658.00	0.07	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	124'503	9'988	28'812	105'679	CHF 123.20	13'019'652.80	0.34	a)
CH0019107025	APG SGA SA	4'267	0	0	4'267	CHF 196.00	836'332.00	0.02	a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	14'950	1'170	6'979	9'141	CHF 415.00	3'793'515.00	0.10	a)
CH0021545667	VAUDOISE ASSURANCES HOL	3'023	435	1'015	2'443	CHF 462.00	1'128'666.00	0.03	a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	324'737	32'844	94'883	262'698	CHF 12.06	3'168'137.88	0.08	a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	1'589	53	357	1'285	CHF 1'250.00	1'606'250.00	0.04	a)
CH0023405456	AVOLTA AG	295'244	19'174	60'238	254'180	CHF 32.92	8'367'605.60	0.22	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	45'496	4'166	14'768	34'894	CHF 31.40	1'095'671.60	0.03	a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	17'846	1'107	4'382	14'571	CHF 254.50	3'708'319.50	0.10	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	62'201	3'975	13'431	52'745	CHF 1'221.00	64'401'645.00	1.67	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	112'080	6'312	22'213	96'179	CHF 235.80	22'679'008.20	0.59	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	58'310	4'917	15'396	47'831	CHF 229.50	10'977'214.50	0.28	a)
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	3'422	0	0	3'422	CHF 1.20	4'106.40	0.00	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	152'975	8'761	32'077	129'659	CHF 263.10	34'113'282.90	0.88	a)
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	11'606	0	0	11'606	CHF 50.00	580'300.00	0.02	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	7'996	353	1'706	6'643	CHF 603.00	4'005'729.00	0.10	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	450'836	27'582	94'227	384'191	CHF 76.82	29'513'552.62	0.76	a)
CH0028422100	BELLEVUE GROUP AG	19'962	0	0	19'962	CHF 16.45	328'374.90	0.01	a)
CH0029850754	ADDEX THERAPEUTICS LTD	1'502	0	0	1'502	CHF 0.08	117.16	0.00	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	91'403	4'678	18'050	78'031	CHF 541.00	42'214'771.00	1.09	a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	51'646	4'566	19'710	36'502	CHF 86.20	3'146'472.40	0.08	a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	20'599	1'038	4'312	17'325	CHF 182.20	3'156'615.00	0.08	a)
CH0032816131	SF URBAN PROPERTIES AG	2'049	0	0	2'049	CHF 92.80	190'147.20	0.00	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	21'765	475	4'327	17'913	CHF 79.90	1'431'248.70	0.04	a)
CH0038285679	ORASCOM DEVELOPMENT HOLDING	42'058	0	0	42'058	CHF 3.98	167'390.84	0.00	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	49'824	495	9'697	40'622	CHF 130.80	5'313'357.60	0.14	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	155'264	17'176	48'704	123'736	CHF 38.95	4'819'517.20	0.12	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	7'353'969	414'610	1'650'711	6'117'868	CHF 91.02	556'848'345.36	14.42	a)
CH0039542854	MCH GROUP AG	12'889	0	0	12'889	CHF 4.07	52'458.23	0.00	a)
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	584	0	0	584	CHF 1'220.00	712'480.00	0.02	a)
CH0042615283	DOCMORRIS AG	37'475	6'255	8'996	34'734	CHF 38.70	1'344'205.80	0.03	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	2'836'052	173'355	707'318	2'302'089	CHF 1.72	3'954'988.90	0.10	a)
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	13'068	0	0	13'068	CHF 16.15	211'048.20	0.01	a)
CH0100837282	KARDEX HOLDING AG-REG	16'970	429	3'555	13'844	CHF 275.00	3'807'100.00	0.10	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	561'365	37'675	119'371	479'669	CHF 49.51	23'748'412.19	0.61	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	216'629	0	0	216'629	CHF 0.19	40'076.37	0.00	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	9'623'899	53'893'813	63'517'712	0	CHF 0.00	0.00	0.00	
CH0110240600	ARBONIA AG	162'287	13'104	51'004	124'387	CHF 13.06	1'624'494.22	0.04	a)
CH0110303119	LECLANCHE SA-REG	194'047	0	0	194'047	CHF 0.24	45'795.09	0.00	a)
CH0111677362	ORIOR AG	22'931	1'902	9'314	15'519	CHF 53.10	824'058.90	0.02	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	52'702	0	0	52'702	CHF 7.25	382'089.50	0.01	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	14'141	0	0	14'141	CHF 28.00	395'948.00	0.01	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	101'372	5'377	23'805	82'944	CHF 68.00	5'640'192.00	0.15	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	800'233	48'486	170'130	678'589	CHF 115.70	78'512'747.30	2.03	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	9'425	762	3'415	6'772	CHF 123.60	837'019.20	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0130293662	BKW AG	56'908	5'200	15'164	46'944 CHF	159.60	7'492'262.40	0.19	a)
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	1'244	0	0	1'244 CHF	1'830.00	2'276'520.00	0.06	a)
CH0187624256	IVF HARTMANN HOLDING AG-REG	87	0	0	87 CHF	137.00	11'919.00	0.00	a)
CH0189396655	GLARNER KANTONALBANK	2'268	0	0	2'268 CHF	21.20	48'081.60	0.00	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	36'638	3'020	13'760	25'898 CHF	27.45	710'900.10	0.02	a)
CH0208062627	MEIER TOBLER GROUP AG	18'094	0	0	18'094 CHF	26.25	474'967.50	0.01	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1'479'582	88'145	311'939	1'255'788 CHF	133.85	168'087'223.80	4.35	a)
CH0212186248	NOVAVEST REAL ESTATE AG	582	0	0	582 CHF	32.70	19'031.40	0.00	a)
CH0212255803	BURKHALTER HOLDING AG	20'667	1'158	870	20'955 CHF	90.40	1'894'332.00	0.05	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	85'411	4'117	22'916	66'612 CHF	78.40	5'222'380.80	0.14	a)
CH0231351104	THURGAUER KANTONALBANK-CERT	9'953	0	0	9'953 CHF	122.50	1'219'242.50	0.03	a)
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	16'632	467	3'769	13'330 CHF	217.50	2'899'275.00	0.08	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	50'636	1'335	9'875	42'096 CHF	129.00	5'430'384.00	0.14	a)
CH0239518779	HIAG IMMOBILIEN AG	16'022	2'990	0	19'012 CHF	78.80	1'498'145.60	0.04	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	4'129	0	0	4'129 CHF	307.50	1'269'667.50	0.03	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	8'423'121	1'006'004	1'885'564	7'543'561 CHF	25.97	195'906'279.17	5.07	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	61'598	0	0	61'598 CHF	5.10	314'149.80	0.01	a)
CH0273774791	INTERSHOP HOLDING AG	3'739	151	3'890	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	27'583	0	5'389	22'194 CHF	54.10	1'200'695.40	0.03	a)
CH0276837694	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	128'157	15'343	55'663	87'837 CHF	13.28	1'166'475.36	0.03	a)
CH0284142913	PLAZZA AG-REG A	3'670	0	0	3'670 CHF	315.00	1'156'050.00	0.03	a)
CH0305285295	VARIA US PROPERTIES AG	3'750	0	0	3'750 CHF	33.00	123'750.00	0.00	a)
CH0305951201	WALLISER KANTONALBANK-REG	8'014	0	0	8'014 CHF	115.00	921'610.00	0.02	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	74'027	4'106	15'127	63'006 CHF	437.20	27'546'223.20	0.71	a)
CH0312309682	ZUEBLIN IMMOBILIEN HOLDI-REG	1'964	0	0	1'964 CHF	26.20	51'456.80	0.00	a)
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	6'393	0	0	6'393 CHF	260.50	1'665'376.50	0.04	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	53'120	3'232	12'643	43'709 CHF	198.50	8'676'236.50	0.22	a)
CH0325094297	INVESTIS HOLDING SA	17'936	0	0	17'936 CHF	110.00	1'972'960.00	0.05	a)
CH0325814116	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	61'332	20'526	15'129	66'729 CHF	15.46	1'031'630.34	0.03	a)
CH0350494719	BANQUE CANTONALE DE GENEV-BR	2'165	271	0	2'436 CHF	266.00	647'976.00	0.02	a)
CH0350665672	BANQUE CANTONALE DU JURA-REG	174	0	0	174 CHF	58.00	10'092.00	0.00	a)
CH0360674466	GALENICA AG	142'217	13'503	39'352	116'368 CHF	73.65	8'570'503.20	0.22	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	21'190	1'591	4'540	18'241 CHF	346.50	6'320'506.50	0.16	a)
CH0363463438	IDORSIA LTD	365'757	34'431	77'143	323'045 CHF	2.14	691'962.39	0.02	a)
CH0371153492	LANDIS + GYR GROUP AG	61'582	6'331	12'715	55'198 CHF	76.40	4'217'127.20	0.11	a)
CH0386200239	MEDARTIS HOLDING AG	10'177	0	0	10'177 CHF	63.50	646'239.50	0.02	a)
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	14'221	0	0	14'221 CHF	1.42	20'193.82	0.00	a)
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	29'933	0	4'741	25'192 CHF	67.00	1'687'864.00	0.04	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	440'730	26'675	92'531	374'874 CHF	272.00	101'965'728.00	2.64	a)
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	13'717	0	0	13'717 CHF	16.40	224'958.80	0.01	a)
CH0432492467	ALCON INC	1'376'301	84'218	293'422	1'167'097 CHF	82.30	96'052'083.10	2.49	a)
CH0435377954	SIG GROUP AG	954'112	52'403	198'235	808'280 CHF	17.94	14'500'543.20	0.38	a)
CH0453226893	ALUFLEXPACK AG	21'039	0	21'039	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	98'689	6'288	24'356	80'621 CHF	134.30	10'827'400.30	0.28	a)
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	17'718	877	3'995	14'600 CHF	130.00	1'898'000.00	0.05	a)
CH0478634105	AEVIS VICTORIA SA	16'575	0	0	16'575 CHF	14.40	238'680.00	0.01	a)
CH0493891243	ZUGER KANTONALBANK-BR	410	0	0	410 CHF	8'360.00	3'427'600.00	0.09	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	310'496	11'762	59'696	262'562 CHF	15.72	4'127'474.64	0.11	a)
CH0516131684	EPIC SUISSE AG	5'577	0	0	5'577 CHF	72.60	404'890.20	0.01	a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	18'675	0	0	18'675 CHF	18.40	343'620.00	0.01	a)
CH0527044959	BERGBAHNEN ENGELB. TRUEB-REG	120	0	0	120 CHF	40.60	4'872.00	0.00	a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	46'994	780	4'350	43'424 CHF	127.40	5'532'217.60	0.14	a)
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	41'336	0	10'827	30'509 CHF	31.90	973'237.10	0.03	a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	82'387	6'939	26'146	63'180 CHF	90.90	5'743'062.00	0.15	a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	7'791	0	0	7'791 CHF	53.80	419'155.80	0.01	a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	8'915	0	1'550	7'365 CHF	258.50	1'903'852.50	0.05	a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	27'195	1'580	5'599	23'176 CHF	570.00	13'210'320.00	0.34	a)
CH1107979838	R&S GROUP HOLDING AG	20'000	17'399	0	37'399 CHF	16.80	628'303.20	0.02	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	84'719	0	2'000	82'719 CHF	19.30	1'596'476.70	0.04	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	44'331	2'080	10'802	35'609 CHF	33.90	1'207'145.10	0.03	a)
CH1129677105	MEDMIX AG	75'985	4'000	20'003	59'982 CHF	10.48	628'611.36	0.02	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	222'487	12'434	52'748	182'173	CHF	67.15	12'232'916.95	0.32 a)
CH1169360919	ACCELLERON INDUSTRIES AG	264'078	20'582	63'301	221'359	CHF	44.36	9'819'485.24	0.25 a)
CH1173567111	GURIT HOLDING AG-BR	9'825	0	453	9'372	CHF	33.85	317'242.20	0.01 a)
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	310'093	36'758	71'072	275'779	CHF	125.45	34'596'475.55	0.90 a)
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	87'317	4'941	17'301	74'957	CHF	81.15	6'082'760.55	0.16 a)
CH1243598427	SANDOZ GROUP AG	1'190'101	70'029	253'861	1'006'269	CHF	37.30	37'533'833.70	0.97 a)
CH1248667003	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG	2'992	0	679	2'313	CHF	409.50	947'173.50	0.02 a)
CH1251125998	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	12'671	0	0	12'671	CHF	1.17	14'825.07	0.00 a)
CH1252930610	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	60'845	0	2'242	58'603	CHF	65.70	3'850'217.10	0.10 a)
CH1256740924	SGS SA-REG	416'663	51'808	102'364	366'107	CHF	94.64	34'648'366.48	0.90 a)
CH1260041939	OBSEVA SA	170'912	0	170'912	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1261338102	PHOENIX MECANO AG - REG	1'926	165	0	2'091	CHF	431.00	901'221.00	0.02 a)
CH1262055788	EVOLVA HOLDING SA	8'190	0	0	8'190	CHF	0.84	6'912.36	0.00 a)
CH1263676327	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	11'225	0	0	11'225	CHF	52.40	588'190.00	0.02 a)
CH1276028821	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	27'139	0	0	27'139	CHF	9.00	244'251.00	0.01 a)
CH1276062754	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	3'073	0	0	3'073	CHF	3.70	11'370.10	0.00 a)
CH1278877563	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-RG	555	0	0	555	CHF	244.00	135'420.00	0.00 a)
CH1335392721	GALDERMA GROUP AG	0	147'404	20'196	127'208	CHF	82.30	10'469'218.40	0.27 a)
CH1338987303	INTERSHOP HOLDING AG	0	19'499	5'356	14'143	CHF	122.80	1'736'760.40	0.04 a)
CH1350861261	PERLEN INDUSTRIEHOLDING AG	0	1'932	1'932	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1351577726	SWISS STEEL HOLDING AG	0	9'632	9'632	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1357065999	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	0	58'023	26'235	31'788	CHF	1.85	58'807.80	0.00 a)
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	13'323	0	2'421	10'902	CHF	19.80	215'859.60	0.01 a)
<b>CH</b>							<b>3'809'258'846.23</b>	<b>98.64</b>	
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	55'572	0	8'357	47'215	CHF	8.50	401'327.50	0.01 a)
<b>IT</b>							<b>401'327.50</b>	<b>0.01</b>	
LI0315487269	VP BANK AG-A	8'821	0	0	8'821	CHF	75.80	668'631.80	0.02 a)
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	32'615	0	0	32'615	CHF	73.10	2'384'156.50	0.06 a)
<b>LI</b>							<b>3'052'788.30</b>	<b>0.08</b>	
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	28'656	0	7'296	21'360	CHF	79.90	1'706'664.00	0.04 a)
<b>NL</b>							<b>1'706'664.00</b>	<b>0.04</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1320916906	DOCMORRIS AG-RTS	0	38'603	38'603	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1326854028	SGS SA	0	414'731	414'731	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1333262389	MEYER BURGER TECHNOLOGY-RTS	0	9'623'899	9'623'899	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1335109828	SWISS STEEL HOLDING-RTS	0	1'926'411	1'926'411	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH1346746170	WARTECK INVEST AG-RTS	0	544	544	0	CHF	0.00	0.00	0.00
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0017142719	UBS ETF SMI	0	6'400	6'400	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0131872431	UBS ETF SPI	0	79'200	79'200	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0237935652	ISHARES CORE SPI CH	0	22'450	22'450	0	CHF	0.00	0.00	0.00
<b>CH</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Nicht kotierte Wertpapiere</b>							<b>1'376.04</b>	<b>0.00</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>1'376.04</b>	<b>0.00</b>	
CH0106213793	SPEXIS AG	24'141	0	0	24'141	CHF	0.06	1'376.04	0.00 c)
<b>CH</b>							<b>1'376.04</b>	<b>0.00</b>	

**Derivative Finanzinstrumente**
**0.00 0.00**
**Futures**
**0.00 0.00**

03/24	SWISS MKT IX FUTR MAR24	180	12	192	0 CHF	0.00	0.00	0.00
03/24	SWISS MID CAP FUT MAR24	167	0	167	0 CHF	0.00	0.00	0.00
06/24	SWISS MKT IX FUTR JUN24	0	797	797	0 CHF	0.00	0.00	0.00
06/24	SWISS MID CAP FUT JUN24	0	167	167	0 CHF	0.00	0.00	0.00
09/24	SWISS MKT IX FUTR SEP24	0	535	236	299 CHF	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	SWISS MID CAP FUT SEP24	0	167	0	167 CHF	0.00	0.00	0.00 a)

**Vermögensaufstellung**
**Kurswert  
CHF in %  
7)**

Bankguthaben auf Sicht	4'789'509.18	0.12
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	3'817'545'975.01	98.86
Sonstige Vermögenswerte	39'376'366.71	1.02
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'861'711'850.90</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-30'488.02	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>3'861'681'362.88</b>	

**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);	3'817'544'598.97	98.86
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.	1'376.04	0.00

**Ausgeliehene Effekten**
**275'350'804.39 7.13**
**Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte**
**275'350'804.39 7.13**

CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	61'000 CHF	4.81	293'166.00	0.01
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	200 CHF	3'600.00	720'000.00	0.02
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	830 CHF	356.50	295'895.00	0.01
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	50 CHF	1'710.00	85'500.00	0.00
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	100 CHF	880.00	88'000.00	0.00
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	14'800 CHF	95.60	1'414'880.00	0.04
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	8'258 CHF	1'376.00	11'363'008.00	0.29
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1'940 CHF	11'220.00	21'766'800.00	0.56
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	2'491 CHF	303.40	755'769.40	0.02
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	9'081 CHF	132.20	1'200'508.20	0.03
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	100'816 CHF	491.40	49'540'982.40	1.28
CH0011178255	TX GROUP AG	1'000 CHF	146.40	146'400.00	0.00
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	1'150 CHF	418.00	480'700.00	0.01
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	688'948 CHF	102.12	70'355'369.76	1.82
CH0012032113	ROCHE HOLDING AG-BR	6'510 CHF	308.40	2'007'684.00	0.05
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	44'601 CHF	13.34	594'977.34	0.02
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	120'910 CHF	35.40	4'280'214.00	0.11
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	10'000 CHF	1.41	14'100.00	0.00
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	5'901 CHF	55.80	329'275.80	0.01
CH0012829898	EMMI AG-REG	1 CHF	883.00	883.00	0.00
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	98'982 CHF	263.10	26'042'164.20	0.67
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	4'655 CHF	182.20	848'141.00	0.02
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	1'300 CHF	79.90	103'870.00	0.00
CH0038388911	SULZER AG-REG	1'750 CHF	130.80	228'900.00	0.01
CH0038863350	NESTLE SA-REG	500'000 CHF	91.02	45'510'000.00	1.18
CH0042615283	DOCMORRIS AG	34'733 CHF	38.70	1'344'167.10	0.03
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	41'838 CHF	7.25	303'325.50	0.01
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	5'000 CHF	123.60	618'000.00	0.02
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	50 CHF	1'830.00	91'500.00	0.00
CH0190891181	LEONTEQ AG	25'897 CHF	27.45	710'872.65	0.02
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	1'270 CHF	217.50	276'225.00	0.01
CH0244017502	BYSTRONIC AG	330 CHF	307.50	101'475.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.08.2024 rung	Wäh- rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	370	CHF	260.50	96'385.00	0.00	
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	8'210	CHF	198.50	1'629'685.00	0.04	
CH0363463438	IDORSIA LTD	323'044	CHF	2.14	691'960.25	0.02	
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	13'313	CHF	67.00	891'971.00	0.02	
CH0432492467	ALCON INC	57'010	CHF	82.30	4'691'923.00	0.12	
CH0435377954	SIG GROUP AG	526'986	CHF	17.94	9'454'128.84	0.24	
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	830	CHF	130.00	107'900.00	0.00	
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	3'226	CHF	570.00	1'838'820.00	0.05	
CH1107979838	R&S GROUP HOLDING AG	29'276	CHF	16.80	491'836.80	0.01	
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	58'902	CHF	81.15	4'779'897.30	0.12	
CH1251125998	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	12'670	CHF	1.17	14'823.90	0.00	
CH1262055788	EVOLVA HOLDING SA	5'000	CHF	0.84	4'220.00	0.00	
CH1263676327	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	1'800	CHF	52.40	94'320.00	0.00	
CH1276028821	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	9'402	CHF	9.00	84'618.00	0.00	
CH1335392721	GALDERMA GROUP AG	100'000	CHF	82.30	8'230'000.00	0.21	
CH1338987303	INTERSHOP HOLDING AG	1'770	CHF	122.80	217'356.00	0.01	
CH1357065999	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	31'787	CHF	1.85	58'805.95	0.00	
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	3'000	CHF	19.80	59'400.00	0.00	

### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

### Devisenkurse

EUR	1 = CHF	0.93915344
USD	1 = CHF	0.84845000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	754'362.60	0.255
Bond	CHF	295'602'366.90	99.745
Total	CHF	296'356'729.50	100.000

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 22)

## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	41'698'924.79	1.080
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.005
FA CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.005
GT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.005
MT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.005
NT CHF	CHF	0.00 - 0.02	-	0.009	0.00 - 0.02	-	0.005

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.

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	275'350'804.39
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.

## 8 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:** 01.03.2024 - 31.08.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
DT CHF	0.150	0.400	0.100	0.050	3.000
FA CHF	0.150	0.500	0.050	0.100	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
MT CHF	-	-	-	-	3.000
NT 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.

## 9 Benchmark

SPI® TR

## 10 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.

## 11 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.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 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:  $\text{Tracking Error} = \text{STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz)} * \text{QUADRATWURZEL}(12)$

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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 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 Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.