

# SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND EUROPE EX CH

## 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	11704466	CHF
FA CHF	31562293	CHF
FT EUR	122485604	EUR
GT CHF	31562311	CHF
GT EUR	37082936	EUR
MT CHF	34283178	CHF
NT CHF	11704465	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	17
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	17
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	18
8	Pauschale Verwaltungskommission	18
9	Benchmark	18
10	TER	18
11	Fussnoten	19
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20

# 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		850'904'723.11	919'729'181.54	827'947'245.39	855'413'402.15
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		6'397'582.06	6'989'784.50	7'901'748.50	9'169'339.60
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		40'073.131	46'024.774	54'737.343	64'475.691
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		159.6477	151.8700	144.3575	142.2139
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		169.9910	159.3795	145.2355	138.0069
Thesaurierung je Anteil		-	3.97	3.72	3.69
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse FA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		37'053'345.26	30'773'798.84	28'260'256.61	26'966'415.33
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		283'132.264	243'097.951	230'701.447	219'265.272
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		130.8694	126.5901	122.4971	122.9853
Ausschüttung je Anteil		-	3.35	3.25	3.20
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	0.18 %
<b>Klasse FT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		10'257'428.86	9'184'784.02	7'687'021.00	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		80'753.380	76'014.594	67'385.870	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		135.2512	126.8038	114.7684	
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		-	3.14	0.75	
Total Expense Ratio (TER)		0.18 %	0.18 %	0.18 %	
<b>Klasse GT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		9'364'048.97	29'050'518.05	29'071'169.15	41'392'955.06
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		60'737.250	198'093.352	208'607.216	301'574.619
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		154.1731	146.6506	139.3584	137.2561
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		164.1618	153.9020	140.2059	133.1958
Thesaurierung je Anteil		-	3.88	3.65	3.61
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse GT EUR</b>					
	<b>EUR</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		95'991'291.62	81'448'312.19	72'632'211.62	51'566'235.05
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		679'198.134	605'859.059	568'551.163	409'832.960
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		150.4869	141.0817	128.5266	122.1005
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		-	3.56	3.34	3.31
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		23'114'849.04	75'571'523.89	71'136'445.54	69'205'210.83
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		154'443.487	530'983.310	526'477.034	520'465.528
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		149.6654	142.3237	135.1179	132.9679
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		159.3621	149.3611	135.9396	129.0344
Thesaurierung je Anteil		-	3.95	3.71	3.69
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

Klasse NT CHF	CHF			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	668'726'177.30	686'710'460.05	611'258'392.97	657'113'246.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode	4'110'919.805	4'439'238.780	4'162'212.674	4'546'798.532
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)	162.6707	154.6910	146.8590	144.5222
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR	173.2099	162.3399	147.7521	140.2469
Thesaurierung je Anteil	-	4.30	4.03	4.02
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	6.04 %	9.69 %	-13.16 %	19.31 %
Klasse FA CHF	6.04 %	9.70 %	-13.14 %	19.30 %
Klasse FT EUR (Lancierung 26.10.2022)	7.59 %	16.69 %	4.41 %	-
Klasse GT CHF	6.06 %	9.74 %	-13.13 %	19.35 %
Klasse GT EUR	7.61 %	16.54 %	-8.84 %	24.58 %
Klasse MT CHF	6.14 %	9.89 %	-13.01 %	19.52 %
Klasse NT CHF	6.14 %	9.89 %	-13.01 %	19.51 %
Benchmark	6.06 %	9.77 %	-13.12 %	19.30 %
Tracking Error 33)	-	0.07 %	0.06 %	0.13 %

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	-0.02 %
Klasse FA CHF	-0.02 %
Klasse FT EUR (Lancierung 26.10.2022)	1.53 %
Klasse GT CHF	-
Klasse GT EUR	1.55 %
Klasse MT CHF	0.08 %
Klasse NT CHF	0.08 %

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	8'377'675.19	6'481'263.14
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	843'870'252.39	920'800'957.35
Sonstige Vermögenswerte	2'030'915.16	1'231'331.22
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>854'278'842.74</b>	<b>928'513'551.71</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-2'641'132.92	-8'765'729.07
Andere Verbindlichkeiten	-732'986.71	-18'641.10
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>850'904'723.11</b>	<b>919'729'181.54</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		46'024.774	54'737.343
Ausgegebene Anteile		748.188	3'678.654
Zurückgenommene Anteile		-6'699.831	-12'391.223
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>40'073.131</b>	<b>46'024.774</b>
<b>Klasse FA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		243'097.951	230'701.447
Ausgegebene Anteile		50'143.713	36'011.962
Zurückgenommene Anteile		-10'109.400	-23'615.458
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>283'132.264</b>	<b>243'097.951</b>
<b>Klasse FT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		76'014.594	67'385.870
Ausgegebene Anteile		7'725.836	19'953.724
Zurückgenommene Anteile		-2'987.050	-11'325.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>80'753.380</b>	<b>76'014.594</b>
<b>Klasse GT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		198'093.352	208'607.216
Ausgegebene Anteile		15'061.170	25'345.410
Zurückgenommene Anteile		-152'417.272	-35'859.274
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>60'737.250</b>	<b>198'093.352</b>
<b>Klasse GT EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		605'859.059	568'551.163
Ausgegebene Anteile		188'389.398	116'330.731
Zurückgenommene Anteile		-115'050.323	-79'022.835
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>679'198.134</b>	<b>605'859.059</b>
<b>Klasse MT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		530'983.310	526'477.034
Ausgegebene Anteile		3'919.515	4'506.276
Zurückgenommene Anteile		-380'459.338	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>154'443.487</b>	<b>530'983.310</b>
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		4'439'238.780	4'162'212.674
Ausgegebene Anteile		622'490.715	767'709.587
Zurückgenommene Anteile		-600'767.553	-490'683.481
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-350'042.137	-
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>4'110'919.805</b>	<b>4'439'238.780</b>

## Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	04.04.2024	58'217'573.05	350'042.137

## 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		919'729'181.54	827'947'245.39
Ausbezahlte Ausschüttung		-916'388.41	-752'661.09
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-7'414'684.93	-7'938'559.46
Saldo aus dem Anteilverkehr		-117'975'199.49	44'593'334.95
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		57'481'814.40	55'879'821.75
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>850'904'723.11</b>	<b>919'729'181.54</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		123'256.90	225'867.31
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		18'577'539.40	24'201'717.41
Erträge der Gratisaktien		134'221.40	756'848.73
Erträge aus Wertpapierleihe		6'315.05	33'085.30
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		1'071'741.92	2'260'408.15
<b>Total Ertrag</b>		<b>19'913'074.67</b>	<b>27'477'926.90</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-12.10	-59.71
Reglementarische Vergütungen		-125'069.24	-220'574.41
Sonstige Aufwendungen		-29'229.64	-3'243.17
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-1'366'608.45	-1'888'538.97
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'520'919.43</b>	<b>-2'112'416.26</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			
		<b>18'392'155.24</b>	<b>25'365'510.64</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		22'065'395.61	-4'823'291.44
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		283'387.36	912'025.17
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		185'406.26	313'125.45
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>40'926'344.47</b>	<b>21'767'369.82</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		16'555'469.93	34'112'451.93
<b>Gesamterfolg</b>		<b>57'481'814.40</b>	<b>55'879'821.75</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>843'870'252.23</b>	<b>98.78</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>843'870'252.23</b>	<b>98.78</b>	
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	37'775	0	2'514	35'261 EUR	49.51	1'639'547.88	0.19	a)
AT0000743059	OMV AG	15'511	0	0	15'511 EUR	39.38	573'656.69	0.07	a)
AT0000746409	VERBUND AG	7'697	0	1'260	6'437 EUR	77.15	466'397.26	0.05	a)
AT0000937503	VOESTALPINE AG	14'631	0	3'394	11'237 EUR	22.08	233'016.14	0.03	a)
<b>AT</b>							<b>2'912'617.97</b>	<b>0.34</b>	
BE0003565737	KBC GROUP NV	29'621	0	4'230	25'391 EUR	70.34	1'677'330.80	0.20	a)
BE0003604155	LOTUS BAKERIES	44	9	11	42 EUR	11'380.00	448'877.78	0.05	a)
BE0003717312	SOFINA	1'658	0	0	1'658 EUR	220.00	342'565.61	0.04	a)
BE0003739530	UCB SA	13'907	0	881	13'026 EUR	163.70	2'002'609.66	0.23	a)
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	11'242	0	2'661	8'581 EUR	69.75	562'106.58	0.07	a)
BE0003822393	ELIA GROUP SA/NV	3'389	0	0	3'389 EUR	99.10	315'414.59	0.04	a)
BE0974259880	D'IETEREN GROUP	2'639	0	462	2'177 EUR	219.00	447'753.61	0.05	a)
BE0974264930	AGEAS	19'584	0	3'423	16'161 EUR	46.52	706'064.68	0.08	a)
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	100'745	4'604	13'368	91'981 EUR	55.30	4'777'050.27	0.56	a)
BE0974320526	UMICORE	23'204	0	23'204	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974349814	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18'334	611	0	18'945 EUR	24.14	429'505.20	0.05	a)
BE0974464977	SYENSQO SA	8'103	0	1'067	7'036 EUR	74.40	491'626.54	0.06	a)
<b>BE</b>							<b>12'200'905.32</b>	<b>1.43</b>	
BMG0112X1056	AEGON LTD	153'218	0	16'500	136'718 USD	6.11	709'277.13	0.08	a)
<b>BM</b>							<b>709'277.13</b>	<b>0.08</b>	
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	24'859	2'703	3'757	23'805 GBP	2'820.00	748'551.24	0.09	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	20'901	0	1'970	18'931 EUR	123.00	2'186'830.99	0.26	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	77'894	3'143	10'982	70'055 EUR	28.77	1'892'847.18	0.22	a)
<b>CH</b>							<b>4'828'229.41</b>	<b>0.57</b>	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	230'016	0	34'618	195'398 EUR	14.75	2'706'386.36	0.32	a)
DE0005158703	BECHTLE AG	9'204	0	1'776	7'428 EUR	38.94	271'646.68	0.03	a)
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	36'375	0	4'461	31'914 EUR	83.82	2'512'265.02	0.29	a)
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6'741	1'139	936	6'944 EUR	78.20	509'979.85	0.06	a)
DE0005200000	BEIERSDORF AG	11'405	0	1'201	10'204 EUR	130.75	1'252'993.16	0.15	a)
DE0005313704	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	4'422	0	0	4'422 EUR	66.35	275'547.34	0.03	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	11'607	0	0	11'607 EUR	61.08	665'818.05	0.08	a)
DE0005470306	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	0	6'162	0	6'162 EUR	84.90	491'321.69	0.06	a)
DE0005552004	DHL GROUP	116'064	4'473	16'511	104'026 EUR	39.20	3'829'697.93	0.45	a)
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	371'235	33'854	46'815	358'274 EUR	25.71	8'650'753.21	1.01	a)
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	45'648	2'702	3'727	44'623 EUR	33.37	1'398'464.75	0.16	a)
DE0005785802	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	23'635	0	2'612	21'023 EUR	34.86	688'269.66	0.08	a)
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	21'632	470	2'607	19'495 EUR	202.90	3'714'854.77	0.43	a)
DE0006047004	HEIDELBERG MATERIALS AG	14'316	0	928	13'388 EUR	95.66	1'202'770.13	0.14	a)
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	11'363	0	0	11'363 EUR	75.15	801'970.78	0.09	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	18'822	1'087	2'937	16'972 EUR	82.76	1'319'137.48	0.15	a)
DE0006062144	COVESTRO AG	22'269	0	2'834	19'435 EUR	55.40	1'011'185.57	0.12	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	148'137	2'733	16'614	134'256 EUR	33.00	4'160'870.48	0.49	a)
DE0006452907	NEMETSCHKE SE	6'824	0	1'005	5'819 EUR	94.25	515'070.02	0.06	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	15'481	513	2'677	13'317 EUR	175.85	2'199'304.31	0.26	a)
DE0006602006	GEA GROUP AG	21'989	0	6'437	15'552 EUR	42.40	619'282.29	0.07	a)
DE0006969603	PUMA SE	11'169	0	0	11'169 EUR	39.09	410'030.83	0.05	a)
DE0007010803	RATIONAL AG	573	0	108	465 EUR	911.50	398'057.84	0.05	a)
DE0007030009	RHEINMETALL AG	4'867	166	543	4'490 EUR	542.00	2'285'505.03	0.27	a)
DE0007037129	RWE AG	71'850	0	7'070	64'780 EUR	32.63	1'985'155.68	0.23	a)
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	91'242	0	14'630	76'612 EUR	62.34	4'485'389.39	0.53	a)
DE0007164600	SAP SE	120'012	2'415	15'229	107'198 EUR	197.72	19'905'534.25	2.33	a)
DE0007165631	SARTORIUS AG-VORZUG	3'017	0	347	2'670 EUR	249.40	625'380.40	0.07	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.
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	87'444	1'688	11'174	77'958	EUR	169.92	12'440'611.90	1.46 a)
DE0007664005	VOLKSWAGEN AG	3'360	0	3'360	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	24'433	0	3'699	20'734	EUR	96.18	1'872'856.15	0.22 a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	68'761	0	12'369	56'392	EUR	5.89	311'832.85	0.04 a)
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	7'425	0	1'381	6'044	EUR	256.30	1'454'821.18	0.17 a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	44'762	811	5'405	40'168	EUR	280.90	10'596'647.83	1.24 a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15'875	0	2'147	13'728	EUR	489.30	6'308'397.34	0.74 a)
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES AG	6'029	331	686	5'674	EUR	270.00	1'438'764.29	0.17 a)
DE000A12DM80	SCOUT24 SE	8'306	1'265	1'345	8'226	EUR	69.10	533'830.41	0.06 a)
DE000A1DAH0	BRENTAG SE	15'832	0	2'880	12'952	EUR	67.22	817'658.39	0.10 a)
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	19'149	396	2'992	16'553	EUR	232.00	3'606'627.20	0.42 a)
DE000A1ML7J1	VONOVIA SE	89'442	0	15'985	73'457	EUR	31.18	2'151'026.95	0.25 a)
DE000A2E4K43	DELIVERY HERO SE	19'668	3'406	3'090	19'984	EUR	28.49	534'701.53	0.06 a)
DE000BASF111	BASF SE	104'921	2'107	15'501	91'527	EUR	45.85	3'941'169.57	0.46 a)
DE000BAY0017	BAYER AG-REG	116'331	3'229	18'685	100'875	EUR	27.87	2'639'849.39	0.31 a)
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	121'891	0	14'473	107'418	EUR	13.38	1'349'800.95	0.16 a)
DE000DTR0CK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	60'370	0	6'015	54'355	EUR	34.66	1'769'312.77	0.21 a)
DE000ENAG999	E.ON SE	251'740	8'407	29'447	230'700	EUR	12.81	2'775'449.17	0.32 a)
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	58'904	13'485	7'239	65'150	EUR	26.05	1'593'891.30	0.19 a)
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	25'676	5'071	5'042	25'705	EUR	20.05	484'025.83	0.06 a)
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	7'538	0	0	7'538	EUR	74.35	526'348.83	0.06 a)
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	7'771	0	0	7'771	EUR	87.06	635'377.93	0.07 a)
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	12'760	0	994	11'766	EUR	70.84	782'787.62	0.09 a)
DE000PAH0038	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17'183	0	1'761	15'422	EUR	40.67	589'049.00	0.07 a)
DE000SHL1006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	32'544	1'708	4'557	29'695	EUR	52.58	1'466'359.53	0.17 a)
DE000SYM9999	SYMRISE AG	16'463	0	2'665	13'798	EUR	119.05	1'542'702.18	0.18 a)
DE000TLX1005	TALANX AG	7'210	1'162	1'279	7'093	EUR	77.85	518'591.18	0.06 a)
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	26'376	0	3'515	22'861	EUR	23.44	503'256.49	0.06 a)
<b>DE</b>							<b>132'078'390.71</b>	<b>15.46</b>	
DK0010181759	CARLSBERG A/S-B	11'087	0	1'205	9'882	DKK	792.00	985'431.86	0.12 a)
DK0010219153	ROCKWOOL A/S-B SHS	942	0	0	942	DKK	2'924.00	346'804.59	0.04 a)
DK0010244425	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	352	0	0	352	DKK	9'795.00	434'113.88	0.05 a)
DK0010244508	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	543	66	174	435	DKK	10'065.00	551'263.96	0.06 a)
DK0010272202	GENMAB A/S	7'997	0	1'445	6'552	DKK	1'873.50	1'545'553.89	0.18 a)
DK0010274414	DANSKE BANK A/S	76'706	0	6'296	70'410	DKK	210.60	1'867'021.33	0.22 a)
DK0060079531	DSV A/S	19'951	0	2'533	17'418	DKK	1'205.00	2'642'663.71	0.31 a)
DK0060094928	ORSTED A/S	21'129	0	1'804	19'325	DKK	390.60	950'404.12	0.11 a)
DK0060252690	PANDORA A/S	9'885	0	1'288	8'597	DKK	1'181.00	1'278'360.64	0.15 a)
DK0060257814	ZEALAND PHARMA A/S	0	6'529	0	6'529	DKK	886.50	728'755.72	0.09 a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	43'879	0	6'316	37'563	DKK	468.00	2'213'414.20	0.26 a)
DK0060448595	COLOPLAST-B	14'279	0	1'696	12'583	DKK	920.20	1'457'884.08	0.17 a)
DK0060636678	TRYG A/S	42'475	0	7'113	35'362	DKK	150.40	669'639.75	0.08 a)
DK0060738599	DEMANT A/S	13'853	0	4'114	9'739	DKK	285.60	350'210.48	0.04 a)
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	113'328	4'370	12'535	105'163	DKK	154.90	2'051'024.99	0.24 a)
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	375'302	3'526	48'199	330'629	DKK	938.10	39'052'302.73	4.57 a)
DK0062616637	SVITZER A/S	0	1'442	1'442	0	DKK	0.00	0.00	0.00
<b>DK</b>							<b>57'124'849.93</b>	<b>6.69</b>	
ES0105046009	AENA SME SA	8'192	0	511	7'681	EUR	182.60	1'317'210.22	0.15 a)
ES0105066007	CELLNEX TELECOM SA	56'824	7'603	10'457	53'970	EUR	34.93	1'770'465.86	0.21 a)
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	50'958	0	4'609	46'349	EUR	60.94	2'652'646.46	0.31 a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	674'684	9'442	93'047	591'079	EUR	9.59	5'323'542.07	0.62 a)
ES0113860A34	BANCO DE SABADELL SA	0	562'045	0	562'045	EUR	1.94	1'025'605.74	0.12 a)
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	1'844'700	0	260'825	1'583'875	EUR	4.50	6'687'807.44	0.78 a)
ES0125220311	ACCIONA SA	2'563	0	0	2'563	EUR	122.30	294'382.25	0.03 a)
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	33'305	528	0	33'833	EUR	14.47	459'775.25	0.05 a)
ES0130670112	ENDESA SA	35'788	0	5'445	30'343	EUR	19.10	544'287.60	0.06 a)
ES0130960018	ENAGAS SA	28'569	0	28'569	0	EUR	0.00	0.00	0.00
ES0140609019	CAIXABANK SA	454'539	0	86'080	368'459	EUR	5.46	1'889'375.87	0.22 a)
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	703'085	50'864	124'513	629'436	EUR	12.82	7'578'376.14	0.89 a)
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	127'538	2'128	18'088	111'578	EUR	48.98	5'132'558.49	0.60 a)
ES0167050915	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22'848	817	2'403	21'262	EUR	41.12	821'095.69	0.10 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.
ES0171996087	GRIFOLS SA	29'907	0	0	29'907 EUR	10.02	281'434.36	0.03	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	45'776	0	5'819	39'957 EUR	17.18	644'692.45	0.08	a)
ES0173516115	REPSOL SA	148'309	0	23'825	124'484 EUR	12.46	1'456'108.78	0.17	a)
ES0178430E18	TELEFONICA SA	572'022	0	151'897	420'125 EUR	4.09	1'615'336.17	0.19	a)
<b>ES</b>							<b>39'494'700.84</b>	<b>4.62</b>	
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	31'694	0	5'243	26'451 EUR	18.37	456'215.03	0.05	a)
FI0009000681	NOKIA OYJ	594'095	0	47'072	547'023 EUR	3.98	2'043'651.88	0.24	a)
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	52'584	4'549	6'133	51'000 EUR	20.02	958'894.45	0.11	a)
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	64'530	0	7'220	57'310 EUR	11.70	629'458.62	0.07	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	60'380	0	6'628	53'752 EUR	30.58	1'543'720.47	0.18	a)
FI0009007132	FORTUM OYJ	51'798	0	7'771	44'027 EUR	14.46	597'893.65	0.07	a)
FI0009007884	ELISA OYJ	18'571	0	4'542	14'029 EUR	45.22	595'790.85	0.07	a)
FI0009013296	NESTE OYJ	53'886	0	10'425	43'461 EUR	21.15	863'269.98	0.10	a)
FI0009013403	KONE OYJ-B	38'960	0	4'797	34'163 EUR	48.80	1'565'713.79	0.18	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	12'729	1'887	2'697	11'919 EUR	47.97	536'965.14	0.06	a)
FI0009014575	METSO CORP	76'627	0	8'446	68'181 EUR	9.18	587'817.62	0.07	a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	359'187	0	37'641	321'546 SEK	121.06	3'225'157.52	0.38	a)
FI4000552500	SAMPO OYJ-A SHS	50'447	2'412	5'804	47'055 EUR	40.41	1'785'793.27	0.21	a)
<b>FI</b>							<b>15'390'342.27</b>	<b>1.80</b>	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	115'957	0	6'848	109'109 EUR	14.16	1'450'464.17	0.17	a)
FR0000051807	TELEPERFORMANCE	6'572	0	1'026	5'546 EUR	98.86	514'916.76	0.06	a)
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	3'661	89	500	3'250 EUR	2'169.00	6'620'327.39	0.77	a)
FR0000064578	COVIVIO	5'863	501	0	6'364 EUR	50.40	301'229.33	0.04	a)
FR0000073272	SAFRAN SA	39'218	791	4'970	35'039 EUR	197.95	6'513'940.13	0.76	a)
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	60'370	6'728	7'626	59'472 EUR	168.72	9'423'574.41	1.10	a)
FR0000120172	CARREFOUR SA	62'623	0	5'780	56'843 EUR	14.58	778'343.08	0.09	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	249'925	6'067	34'930	221'062 EUR	62.19	12'911'336.66	1.51	a)
FR0000120321	L'OREAL	27'643	586	3'487	24'742 EUR	396.60	9'215'609.55	1.08	a)
FR0000120404	ACCOR SA	22'369	0	2'575	19'794 EUR	38.07	707'706.19	0.08	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	23'931	0	4'276	19'655 EUR	32.41	598'258.16	0.07	a)
FR0000120578	SANOFI	130'974	2'567	16'330	117'211 EUR	101.20	11'140'006.32	1.30	a)
FR0000120628	AXA SA	211'787	3'425	29'072	186'140 EUR	34.40	6'013'602.33	0.70	a)
FR0000120644	DANONE	72'436	2'024	7'696	66'764 EUR	62.80	3'937'663.01	0.46	a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	23'146	685	2'785	21'046 EUR	128.80	2'545'786.52	0.30	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	31'780	535	4'087	28'228 EUR	674.30	17'875'978.43	2.09	a)
FR0000121121	EURAZEO SE	4'255	0	0	4'255 EUR	71.30	284'921.78	0.03	a)
FR0000121220	SODEXO SA	10'095	0	1'638	8'457 EUR	80.50	639'364.86	0.07	a)
FR0000121329	THALES SA	11'776	0	1'841	9'935 EUR	152.00	1'418'234.39	0.17	a)
FR0000121485	KERING	8'519	348	1'191	7'676 EUR	259.00	1'867'115.93	0.22	a)
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	33'847	653	4'074	30'426 EUR	214.20	6'120'697.01	0.72	a)
FR0000121709	SEB SA	2'871	0	0	2'871 EUR	94.60	255'070.88	0.03	a)
FR0000121964	KLEPIERRE	23'765	3'354	3'888	23'231 EUR	27.06	590'380.83	0.07	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	62'740	1'405	8'160	55'985 EUR	229.70	12'077'282.68	1.41	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	82'010	0	12'910	69'100 EUR	29.94	1'942'971.35	0.23	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	51'627	0	5'580	46'047 EUR	79.08	3'419'830.29	0.40	a)
FR0000125338	CAPGEMINI SE	17'708	483	2'185	16'006 EUR	187.50	2'818'516.87	0.33	a)
FR0000125486	VINCI SA	57'516	835	7'224	51'127 EUR	108.15	5'192'940.99	0.61	a)
FR0000127771	VIVENDI SE	84'978	8'835	13'001	80'812 EUR	10.15	769'953.43	0.09	a)
FR0000130395	REMY COINTREAU	2'537	0	2'537	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130452	EIFFAGE	9'983	0	2'399	7'584 EUR	94.80	675'216.76	0.08	a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	28'332	900	4'950	24'282 EUR	99.42	2'267'225.76	0.27	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	80'661	0	9'576	71'085 EUR	21.83	1'457'364.74	0.17	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	120'249	1'446	17'373	104'322 EUR	62.58	6'131'235.77	0.72	a)
FR0000131906	RENAULT SA	22'578	0	2'600	19'978 EUR	42.95	805'845.40	0.09	a)
FR0000133308	ORANGE	215'619	0	27'491	188'128 EUR	10.30	1'819'814.90	0.21	a)
FR0004125920	AMUNDI SA	6'631	0	0	6'631 EUR	68.00	423'471.80	0.05	a)
FR0006174348	BUREAU VERITAS SA	33'611	3'010	3'464	33'157 EUR	29.84	929'203.00	0.11	a)
FR0010040865	GECCINA SA	5'803	0	986	4'817 EUR	99.50	450'128.26	0.05	a)
FR0010208488	ENGIE	205'652	6'839	24'901	187'590 EUR	15.93	2'806'480.40	0.33	a)
FR0010220475	ALSTOM	36'873	10'674	6'751	40'796 EUR	18.48	707'845.68	0.08	a)
FR0010259150	IPSEN	4'103	0	0	4'103 EUR	109.70	422'712.12	0.05	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.
FR0010307819	LEGRAND SA	30'473	0	3'571	26'902	EUR	101.20	2'556'828.71	0.30 a)
FR0010313833	ARKEMA	6'668	0	884	5'784	EUR	84.15	457'108.14	0.05 a)
FR0010340141	ADP	3'884	0	0	3'884	EUR	118.50	432'249.13	0.05 a)
FR0010451203	REXEL SA	27'829	0	4'492	23'337	EUR	22.84	500'584.82	0.06 a)
FR0010533075	GETLINK SE	39'515	0	5'865	33'650	EUR	16.32	515'595.00	0.06 a)
FR0010908533	EDENRED	28'035	0	2'425	25'610	EUR	38.21	919'016.21	0.11 a)
FR0011981968	WORLDLINE SA	27'780	0	27'780	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0013154002	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3'199	0	348	2'851	EUR	184.00	492'664.87	0.06 a)
FR0013280286	BIOMERIEUX	4'936	0	919	4'017	EUR	104.70	394'989.06	0.05 a)
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13'679	1'257	2'513	12'423	EUR	72.46	845'398.30	0.10 a)
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	10'860	0	0	10'860	EUR	36.88	376'146.73	0.04 a)
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	78'668	2'546	12'495	68'719	EUR	35.28	2'276'889.54	0.27 a)
FR0014004L86	DASSAULT AVIATION SA	3'040	0	1'033	2'007	EUR	194.80	367'174.81	0.04 a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	80'646	2'539	13'709	69'476	EUR	35.51	2'316'978.65	0.27 a)
NL0000235190	AIRBUS SE	67'906	1'472	8'359	61'019	EUR	138.82	7'955'247.21	0.93 a)
<b>FR</b>								<b>167'249'439.50</b>	<b>19.58</b>
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	45'980	0	6'992	38'988	GBP	1'853.00	805'583.60	0.09 a)
GB0000536739	ASHTREAD GROUP PLC	51'294	1'417	7'873	44'838	GBP	5'398.00	2'698'878.61	0.32 a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	111'481	47'920	16'759	142'642	GBP	507.20	806'735.00	0.09 a)
GB0002374006	DIAGEO PLC	258'621	3'476	34'296	227'801	GBP	2'472.50	6'280'528.14	0.74 a)
GB0002634946	BAE SYSTEMS PLC	348'071	6'532	42'970	311'633	GBP	1'363.00	4'736'347.24	0.55 a)
GB0002875804	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	234'494	2'951	31'881	205'564	GBP	2'836.00	6'500'661.09	0.76 a)
GB0004052071	HALMA PLC	42'035	2'903	5'656	39'282	GBP	2'606.00	1'141'490.34	0.13 a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	257'365	0	31'534	225'831	GBP	779.40	1'962'674.12	0.23 a)
GB0004544929	IMPERIAL BRANDS PLC	99'102	0	17'462	81'640	GBP	2'180.00	1'984'557.69	0.23 a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	2'193'995	11'436	304'311	1'901'120	GBP	666.70	14'133'321.05	1.65 a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	716'770	0	119'235	597'535	GBP	223.80	1'491'171.76	0.17 a)
GB0006731235	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	40'322	0	5'619	34'703	GBP	2'490.00	963'541.90	0.11 a)
GB0006776081	PEARSON PLC	67'291	0	7'698	59'593	GBP	1'056.00	701'719.27	0.08 a)
GB0006825383	PERSIMMON PLC	37'449	0	6'000	31'449	GBP	1'644.00	576'518.03	0.07 a)
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	314'045	0	33'100	280'945	GBP	652.00	2'042'552.09	0.24 a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	130'621	2'842	17'473	115'990	GBP	4'770.00	6'169'403.37	0.72 a)
GB0007669376	ST JAMES'S PLACE PLC	61'382	0	61'382	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0007908733	SSE PLC	132'052	4'919	24'687	112'284	GBP	1'887.00	2'362'620.75	0.28 a)
GB0007980591	BP PLC	1'972'215	17'383	288'437	1'701'161	GBP	429.40	8'145'386.50	0.95 a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	7'282'395	0	917'840	6'364'555	GBP	58.50	4'151'720.89	0.49 a)
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	402'764	0	56'809	345'955	GBP	161.05	621'276.01	0.07 a)
GB0009223206	SMITH & NEPHEW PLC	100'254	0	10'335	89'919	GBP	1'170.50	1'173'618.99	0.14 a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	178'152	3'720	22'722	159'150	GBP	13'274.00	23'556'604.74	2.76 a)
GB0030913577	BT GROUP PLC	755'498	0	72'929	682'569	GBP	139.00	1'057'951.11	0.12 a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	1'712'955	0	200'697	1'512'258	GBP	228.40	3'851'467.42	0.45 a)
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	20'799	0	3'762	17'037	GBP	4'950.00	940'378.22	0.11 a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	41'963	0	41'963	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0032089863	NEXT PLC	13'407	0	1'066	12'341	GBP	10'165.00	1'398'820.45	0.16 a)
GB0033195214	KINGFISHER PLC	215'049	0	32'388	182'661	GBP	284.20	578'860.80	0.07 a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	190'881	0	29'303	161'578	GBP	292.40	526'821.92	0.06 a)
GB00B02JG398	ADMIRAL GROUP PLC	28'501	0	2'835	25'666	GBP	2'918.00	835'117.75	0.10 a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	617'229	0	61'763	555'466	GBP	128.75	797'460.10	0.09 a)
GB00B0744B38	BUNZL PLC	37'740	0	2'607	35'133	GBP	3'540.00	1'386'828.43	0.16 a)
GB00B082RF11	RENTOKIL INITIAL PLC	278'976	15'656	33'195	261'437	GBP	483.00	1'408'051.11	0.16 a)
GB00B05WJX34	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	48'751	7'105	6'903	48'953	GBP	10'250.00	5'595'094.37	0.65 a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	286'927	5'652	36'212	256'367	GBP	4'906.00	14'024'710.46	1.64 a)
GB00B1FH8J72	SEVERN TRENT PLC	34'751	0	6'495	28'256	GBP	2'571.00	810'059.64	0.09 a)
GB00B1KJJ408	WHITBREAD PLC	22'181	0	2'427	19'754	GBP	2'885.00	635'484.71	0.07 a)
GB00B1VZOM25	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36'402	0	0	36'402	GBP	1'111.00	450'965.73	0.05 a)
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	39'379	0	4'819	34'560	GBP	1'802.00	694'436.85	0.08 a)
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	143'705	3'375	15'395	131'685	GBP	2'209.00	3'243'667.00	0.38 a)
GB00B1YW4409	3I GROUP PLC	114'629	3'171	18'214	99'586	GBP	3'179.00	3'530'149.15	0.41 a)
GB00B24CGK77	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	81'175	0	9'958	71'217	GBP	4'366.00	3'467'142.13	0.41 a)
GB00B2B0DG97	RELX PLC	218'000	2'112	27'949	192'163	GBP	3'539.00	7'583'235.99	0.89 a)
GB00B39J2M42	UNITED UTILITIES GROUP PLC	74'723	0	7'379	67'344	GBP	1'019.50	765'579.64	0.09 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.
GB00B3MBS747	OCADO GROUP PLC	68'038	0	68'038	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B52N1N88	SEGO PLC	134'371	8'785	8'693	134'463 GBP	871.20	1'306'245.79	0.15	a)
GB00B63H8491	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	946'664	30'456	104'568	872'552 GBP	496.40	4'829'779.79	0.57	a)
GB00B8C3BL03	SAGE GROUP PLC/THE	117'962	0	13'739	104'223 GBP	1'011.00	1'174'948.86	0.14	a)
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	194'539	3'713	22'552	175'700 GBP	2'399.00	4'700'090.80	0.55	a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	22'773	1'530	2'777	21'526 USD	80.49	1'470'048.01	0.17	a)
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	421'213	120'813	48'609	493'417 GBP	998.60	5'494'268.87	0.64	a)
GB00BF8Q6K64	ABRDN PLC	208'978	0	208'978	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BGXQNP29	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	88'044	0	13'937	74'107 GBP	565.50	467'300.33	0.05	a)
GB00BH4HK539	VODAFONE GROUP PLC	2'781'697	0	409'016	2'372'681 GBP	74.42	1'968'943.51	0.23	a)
GB00BHJYC057	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	19'900	0	3'587	16'313 GBP	7'584.00	1'379'546.68	0.16	a)
GB00BJFFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	16'649	0	3'397	13'252 GBP	4'107.00	606'890.54	0.07	a)
GB00BKF1C65	M&G PLC	229'972	0	0	229'972 GBP	214.40	549'799.05	0.06	a)
GB00BL6K5J42	ENDEAVOUR MINING PLC	20'755	0	4'224	16'531 GBP	1'614.00	297'513.65	0.03	a)
GB00BL9YR756	WISE PLC - A	68'390	10'765	8'212	70'943 GBP	704.50	557'307.38	0.07	a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	814'513	21'439	115'053	720'899 GBP	353.70	2'843'241.31	0.33	a)
GB00BLJNLX82	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	12'395	0	1'638	10'757 GBP	4'984.00	597'824.13	0.07	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	699'388	113'436	134'648	678'176 GBP	345.20	2'610'462.40	0.31	a)
GB00BM8Q5M07	JD SPORTS FASHION PLC	286'505	0	0	286'505 GBP	137.95	440'715.32	0.05	a)
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	161'850	0	22'684	139'166 GBP	834.00	1'294'206.07	0.15	a)
GB00BMWC6P49	MONDI PLC	50'545	0	5'697	44'848 GBP	1'472.00	736'131.04	0.09	a)
GB00BMX86B70	HALEON PLC	688'991	155'798	92'814	751'975 GBP	382.00	3'203'103.74	0.37	a)
GB00BN7SWP63	GSK PLC	467'094	14'132	55'948	425'278 GBP	1'657.00	7'857'776.36	0.92	a)
GB00BNGDN821	MELROSE INDUSTRIES PLC	143'295	0	11'881	131'414 GBP	481.90	706'159.49	0.08	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	745'538	5'359	104'671	646'226 GBP	2'681.00	19'319'037.25	2.26	a)
GB00BP9LHF23	SCHRODERS PLC	93'603	0	0	93'603 GBP	342.40	357'377.96	0.04	a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	308'564	0	39'010	269'554 GBP	504.60	1'516'691.54	0.18	a)
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	99'312	0	10'813	88'499 GBP	851.00	839'792.83	0.10	a)
GB00BWFQGN14	SPIRAX GROUP PLC	9'551	0	1'780	7'771 GBP	7'695.00	666'791.07	0.08	a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	75'371	0	0	75'371 GBP	629.50	529'059.18	0.06	a)
JE00B4T3BW64	GLENCORE PLC	1'182'987	28'852	147'696	1'064'143 GBP	400.80	4'755'891.56	0.56	a)
JE00B8KF9B49	WPP PLC	118'269	0	10'383	107'886 GBP	724.20	871'220.03	0.10	a)
<b>GB</b>							<b>220'537'358.70</b>	<b>25.82</b>	
GB00B19NLV48	EXPERIAN PLC	104'194	2'339	12'826	93'707 GBP	3'684.00	3'849'425.28	0.45	a)
IE0001827041	CRH PLC	79'664	0	79'664	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IE0002424939	DCC PLC	11'549	0	1'381	10'168 GBP	5'355.00	607'154.55	0.07	a)
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	19'846	0	4'326	15'520 EUR	90.80	1'323'470.05	0.15	a)
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	17'286	1'136	2'173	16'249 EUR	78.70	1'200'985.94	0.14	a)
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	117'570	0	12'192	105'378 EUR	10.37	1'026'278.57	0.12	a)
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	174'328	25'588	18'034	181'882 EUR	5.45	930'088.25	0.11	a)
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	20'772	0	20'772	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>IE</b>							<b>8'937'402.64</b>	<b>1.05</b>	
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	70'825	0	10'060	60'765 GBP	646.00	437'713.82	0.05	a)
<b>IM</b>							<b>437'713.82</b>	<b>0.05</b>	
IT0000062072	GENERALI	112'059	0	7'899	104'160 EUR	24.88	2'433'816.89	0.28	a)
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	61'833	0	9'022	52'811 EUR	15.29	758'099.81	0.09	a)
IT0000072170	FINCOBANK SPA	70'322	0	7'265	63'057 EUR	15.45	914'655.97	0.11	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	1'688'140	24'088	226'045	1'486'183 EUR	3.76	5'254'315.47	0.62	a)
IT0003128367	ENEL SPA	951'786	14'267	135'819	830'234 EUR	6.86	5'351'978.30	0.63	a)
IT0003132476	ENI SPA	255'231	16'211	36'347	235'095 EUR	14.67	3'239'876.54	0.38	a)
IT0003153415	SNAM SPA	227'022	20'278	41'948	205'352 EUR	4.48	864'578.10	0.10	a)
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	159'733	0	11'770	147'963 EUR	7.86	1'092'503.21	0.13	a)
IT0003492391	DIASORIN SPA	3'253	869	2'085	2'037 EUR	104.00	198'957.78	0.02	a)
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	1'152'350	0	0	1'152'350 EUR	0.24	258'870.25	0.03	a)
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	58'191	0	8'246	49'945 EUR	12.55	588'670.53	0.07	a)
IT0003828271	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12'394	0	1'762	10'632 EUR	53.00	529'209.21	0.06	a)
IT0003856405	LEONARDO SPA	45'346	0	3'824	41'522 EUR	22.96	895'337.35	0.10	a)
IT0004056880	AMPLIFON SPA	13'711	0	2'731	10'980 EUR	29.13	300'385.79	0.04	a)
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	28'842	2'912	3'958	27'796 EUR	63.40	1'655'038.55	0.19	a)
IT0004965148	MONCLER SPA	22'430	1'615	1'451	22'594 EUR	55.42	1'175'969.88	0.14	a)
IT0005090300	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	36'813	0	0	36'813 EUR	10.82	374'080.46	0.04	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.
IT0005218380	BANCO BPM SPA	135'819	0	13'998	121'821	EUR	6.14	702'926.50	0.08 a)
IT0005239360	UNICREDIT SPA	174'823	0	20'313	154'510	EUR	37.38	5'424'159.39	0.63 a)
IT0005366767	NEXI SPA	67'033	14'256	15'756	65'533	EUR	6.31	388'598.55	0.05 a)
NL0011585146	FERRARI NV	14'736	202	1'980	12'958	EUR	447.20	5'442'222.88	0.64 a)
NL0015435975	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	76'673	0	18'889	57'784	EUR	8.34	452'812.55	0.05 a)
<b>IT</b>							<b>38'297'063.96</b>	<b>4.48</b>	
GB00B0LCW083	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	16'991	0	0	16'991	GBP	1'983.00	375'704.06	0.04 a)
<b>JO</b>							<b>375'704.06</b>	<b>0.04</b>	
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC	15'512	0	1'658	13'854	EUR	51.64	671'889.68	0.08 a)
LU1598757687	ARCELORMITTAL	56'457	0	4'343	52'114	EUR	21.17	1'036'124.21	0.12 a)
LU2598331598	TENARIS SA	50'448	0	4'761	45'687	EUR	13.18	565'301.09	0.07 a)
<b>LU</b>							<b>2'273'314.98</b>	<b>0.27</b>	
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	14'782	0	1'585	13'197	EUR	68.05	843'412.24	0.10 a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	371'896	67'810	33'551	406'155	EUR	3.69	1'408'664.81	0.16 a)
NL0000009165	HEINEKEN NV	32'548	0	3'173	29'375	EUR	81.46	2'247'288.53	0.26 a)
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	88'437	5'919	11'014	83'342	EUR	27.21	2'129'751.90	0.25 a)
NL0000334118	ASM INTERNATIONAL NV	5'578	133	873	4'838	EUR	611.00	2'776'154.47	0.32 a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	12'641	0	1'799	10'842	EUR	43.55	443'439.23	0.05 a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	28'281	578	3'009	25'850	EUR	154.15	3'742'317.50	0.44 a)
NL0006294274	EURONEXT NV	8'850	0	0	8'850	EUR	96.60	802'891.67	0.09 a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	46'417	1'002	6'425	40'994	EUR	812.00	31'261'720.77	3.66 a)
NL0010558797	OCI NV	10'858	0	0	10'858	EUR	28.61	291'745.56	0.03 a)
NL0010773842	NN GROUP NV	30'411	1'295	4'218	27'488	EUR	44.29	1'143'366.27	0.13 a)
NL0010801007	IMCD NV	6'216	0	566	5'650	EUR	147.80	784'258.86	0.09 a)
NL0010832176	ARGENX SE	6'747	228	898	6'077	EUR	468.10	2'671'556.92	0.31 a)
NL0011540547	ABN AMRO BANK NV-CVA	56'181	0	8'455	47'726	EUR	15.49	694'293.35	0.08 a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	107'460	0	10'368	97'092	EUR	31.06	2'832'183.92	0.33 a)
NL0011821202	ING GROEP NV	384'843	5'505	52'999	337'349	EUR	16.39	5'193'987.64	0.61 a)
NL0011872643	ASR NEDERLAND NV	17'011	2'036	1'901	17'146	EUR	44.25	712'545.58	0.08 a)
NL0012059018	EXOR NV	10'573	891	945	10'519	EUR	100.60	993'822.88	0.12 a)
NL0012866412	BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	8'464	0	597	7'867	EUR	117.80	870'344.11	0.10 a)
NL0012969182	ADYEN NV	2'546	70	390	2'226	EUR	1'329.00	2'778'348.34	0.33 a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	21'437	1'562	4'701	18'298	EUR	57.70	991'553.13	0.12 a)
NL0013654783	PROSUS NV	172'288	3'316	30'412	145'192	EUR	33.53	4'572'069.20	0.54 a)
NL0014332678	JDE PEET'S NV	12'468	0	0	12'468	EUR	20.72	242'618.04	0.03 a)
NL00150001Q9	STELLANTIS NV	257'646	0	36'987	220'659	EUR	15.14	3'137'087.99	0.37 a)
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	94'110	0	9'057	85'053	EUR	23.63	1'887'512.83	0.22 a)
NL0015001FS8	FERROVIAL SE	58'874	436	6'457	52'853	EUR	37.74	1'873'303.28	0.22 a)
NL0015001WM6	QIAGEN N.V.	23'707	2'199	3'062	22'844	EUR	41.47	889'698.26	0.10 a)
<b>NL</b>							<b>78'215'937.28</b>	<b>9.16</b>	
NO0003043309	KONGSBERG GRUPPEN ASA	9'513	0	0	9'513	NOK	1'122.00	854'969.18	0.10 a)
NO0003054108	MOWI ASA	59'841	0	11'972	47'869	NOK	184.70	708'208.86	0.08 a)
NO0003733800	ORKLA ASA	89'010	0	19'902	69'108	NOK	94.20	521'458.00	0.06 a)
NO0005052605	NORSK HYDRO ASA	152'679	0	23'336	129'343	NOK	59.40	615'416.99	0.07 a)
NO0010063308	TELENOR ASA	74'833	0	9'590	65'243	NOK	131.50	687'226.32	0.08 a)
NO0010096985	EQUINOR ASA	100'669	0	11'894	88'775	NOK	281.50	2'001'747.00	0.23 a)
NO0010161896	DNB BANK ASA	111'237	6'697	26'322	91'612	NOK	224.10	1'644'501.70	0.19 a)
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	19'681	0	3'739	15'942	NOK	308.80	394'330.35	0.05 a)
NO0010310956	SALMAR ASA	7'056	0	0	7'056	NOK	551.00	311'422.71	0.04 a)
NO0010345853	AKER BP ASA	36'726	0	4'523	32'203	NOK	253.90	654'936.42	0.08 a)
NO0010582521	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	23'487	0	6'313	17'174	NOK	187.90	258'486.79	0.03 a)
NO0010844038	ADEVINTA ASA-B	41'049	0	41'049	0	NOK	0.00	0.00	0.00
<b>NO</b>							<b>8'652'704.32</b>	<b>1.01</b>	
LU2290522684	INPOST SA	0	18'126	0	18'126	EUR	16.66	283'604.77	0.03 a)
<b>PL</b>							<b>283'604.77</b>	<b>0.03</b>	
PTEDPOAM0009	EDP SA	348'221	23'918	39'703	332'436	EUR	3.80	1'185'143.14	0.14 a)
PTGAL0AM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	52'099	0	5'606	46'493	EUR	18.76	819'137.78	0.10 a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	32'839	0	4'816	28'023	EUR	16.74	440'561.59	0.05 a)
<b>PT</b>							<b>2'444'842.51</b>	<b>0.29</b>	

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.
SE0000106270	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	71'013	0	6'111	64'902 SEK	162.50	873'787.75	0.10	a)
SE0000107203	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	17'994	0	2'814	15'180 SEK	368.40	463'325.17	0.05	a)
SE0000108227	SKF AB-B SHARES	37'139	0	4'504	32'635 SEK	194.25	525'217.45	0.06	a)
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	333'947	0	43'520	290'427 SEK	76.52	1'841'223.27	0.22	a)
SE0000108847	LUNDBERGS AB-B SHS	9'020	1'811	1'807	9'024 SEK	563.00	420'922.35	0.05	a)
SE0000112385	SAAB AB-B	8'807	0	8'807	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0000112724	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	70'947	0	9'024	61'923 SEK	142.55	731'330.55	0.09	a)
SE0000113250	SKANSKA AB-B SHS	36'059	0	0	36'059 SEK	207.30	619'309.13	0.07	a)
SE0000114837	TRELLEBORG AB-B SHS	0	22'559	0	22'559 SEK	400.20	747'982.49	0.09	a)
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	22'293	0	0	22'293 SEK	276.20	510'136.85	0.06	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	177'501	13'065	29'966	160'600 SEK	272.60	3'627'153.18	0.42	a)
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	184'893	6'983	29'948	161'928 SEK	158.00	2'119'695.82	0.25	a)
SE0000163594	SECURITAS AB-B SHS	50'414	0	0	50'414 SEK	120.00	501'218.29	0.06	a)
SE0000190126	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	16'213	0	2'979	13'234 SEK	369.20	404'806.36	0.05	a)
SE0000202624	GETINGE AB-B SHS	24'660	0	0	24'660 SEK	213.60	436'404.10	0.05	a)
SE0000242455	SWEDBANK AB - A SHARES	102'679	0	15'420	87'259 SEK	219.40	1'586'139.42	0.19	a)
SE0000667891	SANDVIK AB	122'491	0	17'701	104'790 SEK	218.30	1'895'256.88	0.22	a)
SE0000667925	TELIA CO AB	278'222	0	43'384	234'838 SEK	31.84	619'492.33	0.07	a)
SE0000695876	ALFA LAVAL AB	31'576	0	2'441	29'135 SEK	459.90	1'110'127.69	0.13	a)
SE0000872095	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	24'644	0	5'817	18'827 SEK	320.00	499'143.71	0.06	a)
SE0001515552	INDUTRADE AB	29'024	0	0	29'024 SEK	322.80	776'220.84	0.09	a)
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	51'894	0	13'254	38'640 SEK	69.12	221'276.53	0.03	a)
SE0005127818	SAGAX AB-B	22'103	3'774	3'725	22'152 SEK	270.60	496'632.62	0.06	a)
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	60'328	8'856	12'236	56'948 SEK	116.50	549'666.04	0.06	a)
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	113'271	3'359	14'036	102'594 SEK	331.10	2'814'334.07	0.33	a)
SE0007100599	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	177'227	0	28'895	148'332 SEK	105.90	1'301'443.50	0.15	a)
SE0009922164	ESSITY AKTIEBOLAG-B	69'527	0	6'865	62'662 SEK	311.60	1'617'693.37	0.19	a)
SE0010100958	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	15'964	0	0	15'964 SEK	308.60	408'161.60	0.05	a)
SE0011090018	HOLMEN AB-B SHARES	10'137	0	2'371	7'766 SEK	420.20	270'363.42	0.03	a)
SE0012673267	EVOLUTION AB	20'449	0	1'651	18'798 SEK	1'066.50	1'660'989.97	0.19	a)
SE0012853455	EQT AB	40'843	0	3'115	37'728 SEK	342.80	1'071'517.09	0.13	a)
SE0014781795	ADDTECH AB-B SHARES	0	26'518	0	26'518 SEK	324.80	713'594.17	0.08	a)
SE0015658109	EPIROC AB-A	72'522	0	5'234	67'288 SEK	197.80	1'102'702.63	0.13	a)
SE0015658117	EPIROC AB-B	43'941	0	5'522	38'419 SEK	182.30	580'266.14	0.07	a)
SE0015811963	INVESTOR AB-B SHS	196'147	3'324	20'878	178'593 SEK	305.35	4'518'110.64	0.53	a)
SE0015949201	LIFCO AB-B SHS	32'601	0	10'280	22'321 SEK	343.00	634'311.04	0.07	a)
SE0015949748	BEIJER REF AB	44'790	0	6'579	38'211 SEK	176.70	559'396.13	0.07	a)
SE0015961909	HEXAGON AB-B SHS	247'554	9'676	42'349	214'881 SEK	105.00	1'869'312.11	0.22	a)
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	175'494	0	21'949	153'545 SEK	50.64	644'204.69	0.08	a)
SE0016844831	VOLVO CAR AB-B	61'112	0	61'112	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0017486889	ATLAS COPCO AB-A SHS	315'561	6'355	46'425	275'491 SEK	186.15	4'248'787.01	0.50	a)
SE0017486897	ATLAS COPCO AB-B SHS	175'306	6'241	21'271	160'276 SEK	163.20	2'167'120.97	0.25	a)
SE0017832488	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	68'136	0	0	68'136 SEK	80.50	454'430.03	0.05	a)
SE0020050417	BOLIDEN AB	29'146	0	0	29'146 SEK	314.00	758'233.75	0.09	a)
SE0021628898	VOLVO CAR AB-B	0	61'112	0	61'112 SEK	29.38	148'755.42	0.02	a)
SE0021921269	SAAB AB-B	0	30'848	0	30'848 SEK	242.35	619'390.50	0.07	a)
<b>SE</b>							<b>49'739'587.07</b>	<b>5.82</b>	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	23'048	0	2'647	20'401 USD	97.42	1'686'265.04	0.20	a)
<b>US</b>							<b>1'686'265.04</b>	<b>0.20</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
BE6349605822	WAREHOUSES DE PAUW CVA-SCRIP	0	18'334	18'334	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A3EX3N6	VONOVIA SE-SCRIP	0	73'457	73'457	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000LEG1268	LEG IMMOBILIEN SE-SCRIP	0	7'771	7'771	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0627797915	EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	0	33'305	33'305	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0644580957	IBERDROLA SA-RTS	0	578'572	578'572	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509P5	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	0	20'445	20'445	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400OP17	ESSILORLUXOTTICA SA-SCRIP	0	29'773	29'773	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400P9F6	COVIVIO SA/FRANCE	0	5'863	5'863	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400Q9B4	ALSTOM SA-RTS	0	30'122	30'122	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400RCT9	REMY COINTREAU SA-RTS	0	2'537	0	2'537 EUR	0.00	0.00	0.00	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.
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	745'538	0	745'538	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9Z14	SHELL PLC - EEE JUN24	0	651'939	651'939	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1WB003	SHELL PLC - EEE SEPT24	0	640'867	0	640'867 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
GB00BSRK4X90	NATIONAL GRID PLC-FULL	0	1'087	1'087	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BSRK4Y08	NATIONAL GRID PLC-NIL	0	1'087	1'087	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
IT0005598021	AMPLIFON SPA-RTS	0	10'980	10'980	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001YZ4	ABN AMRO BANK NV	0	47'726	47'726	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001Z20	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	25'272	25'272	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001ZB2	NN GROUP NV-SCRIP	0	26'193	26'193	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150021M6	UNIVERSAL MUSIC GROUP N-DRIP	0	85'053	85'053	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150023G4	ARCELORMITTAL SA	0	52'114	52'114	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150023I0	FERROVIAL SE - SCRIP	0	52'417	52'417	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150024P3	AEGON LTD-DRIP	0	136'718	136'718	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150026X2	WOLTERS KLUWER NV -DRIP	0	25'272	0	25'272 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
NL00150027H3	ABN AMRO BANK NV	0	47'726	0	47'726 EUR	0.00	0.00	0.00	a)

**Diverse**

**0.00 0.00**

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

**0.00 0.00**

**Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte**

**0.00 0.00**

ES0127797035	EDP RENOVAVEIS SA	0	528	528	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144583301	IBERDROLA SA - ENT	0	17'016	17'016	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050261	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	0	817	817	0 EUR	0.00	0.00	0.00	

**ES**

**0.00 0.00**

IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	29'532	0	29'532	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
--------------	-------------------------	--------	---	--------	-------	------	------	------	--

**IE**

**0.00 0.00**

SE0021628914	VOLVO CAR AB -RED SHS	0	61'112	61'112	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
--------------	-----------------------	---	--------	--------	-------	------	------	------	--

**SE**

**0.00 0.00**

**Nicht kotierte Wertpapiere**

**0.16 0.00**

**Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte**

**0.16 0.00**

GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	13'613	0	0	13'613 GBP	0.00	0.16	0.00	c)
--------------	----------------	--------	---	---	------------	------	------	------	----

**AE**

**0.16 0.00**



**Derivative Finanzinstrumente** 0.00 0.00

<b>Futures</b>									0.00	0.00
03/24	EURO STOXX 50	MAR24	96	36	132	0	EUR	0.00	0.00	0.00
03/24	FTSE 100 IDX FUT	MAR24	22	9	31	0	GBP	0.00	0.00	0.00
06/24	EURO STOXX 50	JUN24	0	538	538	0	EUR	0.00	0.00	0.00
06/24	FTSE 100 IDX FUT	JUN24	0	147	147	0	GBP	0.00	0.00	0.00
09/24	EURO STOXX 50	SEP24	0	462	316	146	EUR	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	FTSE 100 IDX FUT	SEP24	0	103	70	33	GBP	0.00	0.00	0.00 a)

<b>Devisentermingeschäfte</b>									0.00	0.00
	EUR/CHF	Verfall 07.05.2024	292'868	300'000			CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/GBP	Verfall 10.05.2024	600'000	698'784			GBP/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall 27.08.2024	1'894'256	2'000'000			CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF	Verfall 27.08.2024	47'598	375'000			CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF	Verfall 27.08.2024	102'435	1'231'000			CHF/SEK	0.00	0.00	

<b>Vermögensaufstellung</b>			Kurswert CHF	in % (7)
Bankguthaben auf Sicht			8'377'675.19	0.98
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte			843'870'252.39	98.78
Sonstige Vermögenswerte			2'030'915.16	0.24
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>854'278'842.74</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten			-2'641'132.92	
Andere Verbindlichkeiten			-732'986.71	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>850'904'723.11</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>			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);		843'870'252.23	98.78
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.		0.16	0.00

<b>Ausgeliehene Effekten</b>						2'564'793.31	0.30
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>						<b>2'564'793.31</b>	<b>0.30</b>
FR000130809	SOCIETE GENERALE SA		30'000	EUR	21.83	615'051.59	0.07
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV		66'912	EUR	28.77	1'807'925.07	0.21
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		28'000	SEK	50.64	117'475.21	0.01
SE0021628898	VOLVO CAR AB-B		10'000	SEK	29.38	24'341.44	0.00

**OTC Gegenparteien**

---

Zürcher Kantonalbank

**Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler**

---

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

DKK	100 = CHF	12.59089400
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
NOK	100 = CHF	8.01014000
SEK	100 = CHF	8.28503800
USD	1 = CHF	0.84845000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	1'172'630.00	43.572
Bond	CHF	1'318'925.93	49.008
Equity	CHF	199'698.02	7.420
Total	CHF	2'691'253.95	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	9'880'593.26	1.161
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 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008
FA CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008
FT EUR	CHF	0.00 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008
GT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008
GT EUR	CHF	0.00 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008
MT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008
NT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.142	0.00 - 0.04	-	0.008

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

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	2'564'793.31
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	0.180	0.400	0.130	0.050	3.000
FA CHF	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
FT EUR	0.180	0.500	0.080	0.100	3.000
GT CHF	0.140	0.350	0.090	0.050	3.000
GT EUR	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

MSCI Europe ex Switzerland Index TR Net

## 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.