

# SWISSCANTO (CH) INDEX BOND FUND WORLD (EX JPY/CHF) INFLATION-LINKED

## 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>
FAH1 CHF	31562134	CHF
NTH1 CHF	11704835	CHF
STH1 CHF	127100537	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	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	15
10	Fussnoten	15
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

# 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		221'365'191.91	290'895'155.24	250'671'180.29	211'024'747.69
<b>Klasse FAH1 CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'269'664.91	10'211'016.99	14'906'264.97	16'010'219.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		27'480.035	124'069.216	176'133.152	150'215.772
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		82.5932	82.3010	84.6307	106.5815
Ausschüttung je Anteil		-	0.05	0.15	2.60
Total Expense Ratio (TER)		0.25 %	0.25 %	0.25 %	0.25 %
<b>Klasse NTH1 CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		161'618'038.47	227'782'158.06	235'764'915.32	195'014'528.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'502'008.226	2'128'393.204	2'148'692.096	1'439'826.113
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		107.6013	107.0207	109.7248	135.4431
Thesaurierung je Anteil		-	-	0.41	3.61
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse STH1 CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		57'477'488.53	52'901'980.19		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		582.399	538.945		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		98'690.9121	98'158.4024		
Total Expense Ratio (TER)		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 FAH1 CHF	0.42 %	-0.29 %	-19.93 %	3.95 %
Klasse NTH1 CHF	0.54 %	-0.04 %	-19.72 %	4.21 %
Klasse STH1 CHF (Lancierung 31.05.2023)	0.54 %	0.68 %	-	-
Benchmark Hedge	0.51 %	-2.36 %	-19.72 %	-
Benchmark	-	-	-	4.10 %
Tracking Error <sup>33)</sup>	-	0.09 %	0.17 %	0.10 %

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 FAH1 CHF	-0.09 %
Klasse NTH1 CHF	0.03 %
Klasse STH1 CHF (Lancierung 31.05.2023)	0.03 %

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

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.08.2024	29.02.2024
Bankguthaben auf Sicht	3'825'837.21	1'416'451.33
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	219'066'533.09	288'588'829.28
Derivative Finanzinstrumente	-1'100.27	0.00
Sonstige Vermögenswerte	626'639.45	891'918.22
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>223'517'909.48</b>	<b>290'897'198.83</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-2'152'249.99	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-467.58	-2'043.59
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>221'365'191.91</b>	<b>290'895'155.24</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse FAH1 CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		124'069.216	176'133.152
Ausgegebene Anteile		1'331.121	6'262.590
Zurückgenommene Anteile		-97'920.302	-58'326.526
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>27'480.035</b>	<b>124'069.216</b>

Klasse NTH1 CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'128'393.204	2'148'692.096
Ausgegebene Anteile		173'335.695	1'252'672.150
Zurückgenommene Anteile		-799'720.673	-1'272'971.042
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'502'008.226</b>	<b>2'128'393.204</b>

Klasse STH1 CHF	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		538.945	-
Ausgegebene Anteile		43.454	538.945
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>582.399</b>	<b>538.945</b>

Lancierung

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		290'895'155.24	250'671'180.29
Ausbezahlte Ausschüttung		-1'362.80	-21'474.54
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		0.00	-179'576.74
Saldo aus dem Anteilverkehr		-70'833'487.77	47'268'902.66
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		1'304'887.24	-6'843'876.43
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>221'365'191.91</b>	<b>290'895'155.24</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		7'589.43	14'170.41
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		-3'770'258.92	-8'546'721.72
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		0.00	175'472.57
Sonstige Erträge		33'856.39	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-144'018.36	-4'391'975.05
<b>Total Ertrag</b>		<b>-3'872'831.46</b>	<b>-12'749'053.79</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-932.17	-0.44
Reglementarische Vergütungen		-6'339.58	-30'441.24
Sonstige Aufwendungen		-42.00	-84.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		948'261.12	2'565'190.70
<b>Total Aufwand</b>		<b>940'947.37</b>	<b>2'534'665.02</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>-2'931'884.09</b>	<b>-10'214'388.77</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-1'726'528.80	-3'126'038.81
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		50'638.18	419'956.22
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-4'607'774.71</b>	<b>-12'920'471.36</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		5'912'661.95	6'076'594.93
<b>Gesamterfolg</b>		<b>1'304'887.24</b>	<b>-6'843'876.43</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>219'066'533.09</b>	<b>98.01</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>219'066'533.09</b>	<b>98.01</b>	
AU0000024044	1.0000 % ACGB 1 02/21/50 50CI	475	0	90	385 AUD	96.81%	214'555.23	0.10	a)
AU0000171134	0.2500 % ACGB 0 1/4 11/21/32 32CI	550	80	180	450 AUD	104.35%	270'308.85	0.12	a)
AU0000XCLWP8	3.0000 % ACGB 3 09/20/25 25CI	938	0	420	518 AUD	150.62%	449'144.03	0.20	a)
AU0000XCLWV6	2.5000 % ACGB 2 1/2 09/20/30 30CI	844	50	280	614 AUD	153.05%	540'972.24	0.24	a)
AU000XCLWAF4	2.0000 % ACGB 2 08/21/35 35CI	531	0	0	531 AUD	137.71%	420'967.65	0.19	a)
AU000XCLWAO6	1.2500 % ACGB 1 1/4 08/21/40 40CI	588	80	230	438 AUD	117.13%	295'324.74	0.13	a)
AU000XCLWAV1	0.7500 % ACGB 0 3/4 11/21/27 27CI	815	80	280	615 AUD	122.51%	433'736.84	0.19	a)
<b>AUD</b>							<b>2'625'009.58</b>	<b>1.17</b>	
CA135087B949	1.2500 % CANRRB 1 1/4 12/01/47 CPI	840	40	260	620 CAD	121.23%	473'174.25	0.21	a)
CA135087G997	0.5000 % CANRRB 0 1/2 12/01/50 CPI	860	0	260	600 CAD	95.74%	361'614.51	0.16	a)
CA135087M433	0.2500 % CANRRB 0 1/4 12/01/54 CPI	220	0	50	170 CAD	81.26%	86'966.54	0.04	a)
CA135087VS05	4.2500 % CANRRB 4 1/4 12/01/26 CPI	556	0	170	386 CAD	194.80%	473'366.09	0.21	a)
CA135087VV25	4.0000 % CANRRB 4 12/01/31 CPI	620	0	190	430 CAD	208.29%	563'849.33	0.25	a)
CA135087XQ21	3.0000 % CANRRB 3 12/01/36 CPI	619	40	190	469 CAD	182.00%	537'353.05	0.24	a)
CA135087YK42	2.0000 % CANRRB 2 12/01/41 CPI	703	0	210	493 CAD	151.28%	469'512.31	0.21	a)
CA135087ZH04	1.5000 % CANRRB 1 1/2 12/01/44 CPI	878	0	300	578 CAD	135.23%	492'052.79	0.22	a)
<b>CAD</b>							<b>3'457'888.87</b>	<b>1.55</b>	
DE0001030559	0.5000 % DBRI 0 1/2 04/15/30 I/L	2'628	150	860	1'918 EUR	127.02%	2'288'012.15	1.02	a)
DE0001030567	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/26 I/L	2'192	60	660	1'592 EUR	124.05%	1'854'673.61	0.83	a)
DE0001030575	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/46 I/L	1'653	90	510	1'233 EUR	116.35%	1'347'277.27	0.60	a)
DE0001030583	0.1000 % DBRI 0.1 04/15/33 I/L	1'260	50	410	900 EUR	117.14%	990'119.09	0.44	a)
ES00000127C8	1.0000 % SPGBEI 1 11/30/30	2'034	110	640	1'504 EUR	125.90%	1'778'254.32	0.80	a)
ES00000128S2	0.6500 % SPGBEI 0.65 11/30/27	1'915	180	590	1'505 EUR	124.33%	1'757'380.72	0.79	a)
ES0000012C12	0.7000 % SPGBEI 0.7 11/30/33	2'224	170	660	1'734 EUR	118.84%	1'935'340.35	0.87	a)
ES0000012M69	2.0500 % SPGBEI 2.05 11/30/39	410	70	40	440 EUR	113.91%	470'714.28	0.21	a)
FR0000186413	3.4000 % FRTR 3.4 07/25/29 OATI	1'157	40	370	827 EUR	166.20%	1'290'849.75	0.58	a)
FR0000188799	3.1500 % FRTR 3.15 07/25/32 OATE	1'398	80	430	1'048 EUR	182.33%	1'794'558.57	0.80	a)
FR0010447367	1.8000 % FRTR 1.8 07/25/40 OATE	1'498	80	430	1'148 EUR	157.50%	1'698'061.99	0.76	a)
FR0011008705	1.8500 % FRTR 1.85 07/25/27 OATE	2'736	160	860	2'036 EUR	138.59%	2'649'998.87	1.19	a)
FR0011982776	0.7000 % FRTR 0.7 07/25/30 OATE	2'002	100	620	1'482 EUR	125.63%	1'748'515.04	0.78	a)
FR0012558310	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/25 OATI	1'100	0	1'100	0 EUR	117.60%	0.00	0.00	
FR0013209871	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/47 OATE	1'516	80	470	1'126 EUR	98.45%	1'041'095.94	0.47	a)
FR0013238268	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/28 OATI	1'828	120	520	1'428 EUR	114.87%	1'540'577.92	0.69	a)
FR0013327491	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/36 OATE	1'488	150	470	1'168 EUR	110.46%	1'211'681.63	0.54	a)
FR0013410552	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/29 OATE	2'054	340	490	1'904 EUR	117.02%	2'092'437.32	0.94	a)
FR0013519253	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/26 OATE	1'460	75	440	1'095 EUR	117.75%	1'210'935.96	0.54	a)
FR0013524014	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/36 OATI	980	200	290	890 EUR	102.01%	852'619.58	0.38	a)
FR0014001N38	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/31 OATE	1'360	70	420	1'010 EUR	114.45%	1'085'632.86	0.49	a)
FR0014003N51	0.1000 % FRTR 0.1 03/01/32 OATI	790	30	220	600 EUR	107.26%	604'383.11	0.27	a)
FR0014008181	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/53 OATE	740	130	190	680 EUR	88.30%	563'886.13	0.25	a)
FR001400AQH0	0.1000 % FRTR 0.1 07/25/38 OATE	830	40	260	610 EUR	102.59%	587'713.61	0.26	a)
FR001400IKW5	0.5500 % FRTR 0.55 03/01/39 OATI	350	0	70	280 EUR	96.42%	253'541.34	0.11	a)
FR001400JI88	0.6000 % FRTR 0.6 07/25/34 OATE	380	80	60	400 EUR	105.36%	395'790.29	0.18	a)
FR001400QCA1	0.9500 % FRTR 0.95 07/25/43 OATE	0	340	0	340 EUR	98.46%	314'406.90	0.14	a)
IT0003745541	2.3500 % BTPS 2.35 09/15/35 CPI	1'515	80	470	1'125 EUR	158.02%	1'669'548.52	0.75	a)
IT0004545890	2.5500 % BTPS 2.55 09/15/41 CPI	1'645	190	470	1'365 EUR	144.26%	1'849'283.70	0.83	a)
IT0004735152	3.1000 % BTPS 3.1 09/15/26 CPI	1'440	30	430	1'040 EUR	138.30%	1'350'773.19	0.60	a)
IT0005138828	1.2500 % BTPS 1 1/4 09/15/32 CPI	1'699	90	530	1'259 EUR	122.28%	1'445'781.12	0.65	a)
IT0005246134	1.3000 % BTPS 1.3 05/15/28 CPI	1'863	90	590	1'363 EUR	125.19%	1'602'557.93	0.72	a)
IT0005387052	0.4000 % BTPS 0.4 05/15/30 CPI	1'599	150	490	1'259 EUR	114.13%	1'349'497.10	0.60	a)
IT0005415416	0.6500 % BTPS 0.65 05/15/26 CPI	1'080	50	320	810 EUR	118.04%	897'928.81	0.40	a)
IT0005436701	0.1500 % BTPS 0.15 05/15/51 CPI	795	20	250	565 EUR	75.07%	398'357.49	0.18	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.
IT0005482994	0.1000 % BTPS 0.1 05/15/33 CPI	2'020	230	630	1'620	EUR	101.09%	1'537'989.78	0.69 a)
IT0005543803	1.5000 % BTPS 1 1/2 05/15/29 CPI	990	180	110	1'060	EUR	104.14%	1'036'758.66	0.46 a)
IT0005547812	2.4000 % BTPS 2.4 05/15/39 CPI	660	130	200	590	EUR	106.55%	590'419.38	0.26 a)
IT0005588881	1.8000 % BTPS 1.8 05/15/36 CPI	0	610	80	530	EUR	99.19%	493'695.84	0.22 a)
<b>EUR</b>							<b>47'581'050.12</b>	<b>21.29</b>	
GB0008932666	4.1250 % UKTI 4 1/8 07/22/30 8MO	498	20	150	368	GBP	344.50%	1'413'627.48	0.63 a)
GB0031790826	2.0000 % UKTI 2 01/26/35 8MO	966	50	300	716	GBP	248.77%	1'986'124.82	0.89 a)
GB00B0CNHZ09	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/55 3MO	1'149	60	350	859	GBP	198.80%	1'904'167.04	0.85 a)
GB00B128DH60	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/27 3MO	1'618	40	500	1'158	GBP	205.99%	2'659'831.14	1.19 a)
GB00B1L6W962	1.1250 % UKTI 1 1/8 11/22/37 3MO	1'493	70	460	1'103	GBP	198.91%	2'446'451.00	1.09 a)
GB00B24FFM16	0.7500 % UKTI 0 3/4 11/22/47 3MO	1'353	70	420	1'003	GBP	167.54%	1'873'814.01	0.84 a)
GB00B3D4VD98	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/32 3MO	1'706	80	530	1'256	GBP	190.43%	2'667'063.05	1.19 a)
GB00B3LZBF68	0.6250 % UKTI 0 5/8 03/22/40 3MO	1'638	80	510	1'208	GBP	168.93%	2'275'537.23	1.02 a)
GB00B3MYD345	0.6250 % UKTI 0 5/8 11/22/42 3MO	1'459	70	450	1'079	GBP	168.35%	2'025'488.11	0.91 a)
GB00B3Y1JG82	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/29 3MO	1'791	90	550	1'331	GBP	161.85%	2'402'124.92	1.07 a)
GB00B421JZ66	0.5000 % UKTI 0 1/2 03/22/50 3MO	1'419	80	440	1'059	GBP	149.40%	1'764'223.19	0.79 a)
GB00B46CGH68	0.7500 % UKTI 0 3/4 03/22/34 3MO	1'691	90	530	1'251	GBP	169.32%	2'361'984.35	1.06 a)
GB00B4PTCY75	0.3750 % UKTI 0 3/8 03/22/62 3MO	1'449	70	450	1'069	GBP	121.36%	1'446'684.62	0.65 a)
GB00B73ZYW09	0.2500 % UKTI 0 1/4 03/22/52 3MO	1'452	70	460	1'062	GBP	120.41%	1'425'904.88	0.64 a)
GB00B7RN0G65	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/44 3MO	1'819	100	560	1'359	GBP	129.72%	1'965'739.42	0.88 a)
GB00BD9MZZ71	0.1250 % UKTI 0 1/8 11/22/65 3MO	944	50	290	704	GBP	96.02%	753'768.46	0.34 a)
GB00BDX8CX86	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/68 3MO	1'463	70	450	1'083	GBP	98.46%	1'188'997.94	0.53 a)
GB00BGDYHF49	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/41 3MO	1'443	80	450	1'073	GBP	118.53%	1'418'217.60	0.63 a)
GB00BLH38265	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/39 3MO	1'200	260	300	1'160	GBP	115.47%	1'493'546.27	0.67 a)
GB00BM8Z2W66	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/2073 3MO	510	30	110	430	GBP	82.55%	395'807.57	0.18 a)
GB00BMF9LH90	0.6250 % UKTI 0 5/8 03/22/45 3MO	940	130	300	770	GBP	94.46%	811'050.11	0.36 a)
GB00BMF9LJ15	0.7500 % UKTI 0 3/4 11/22/33 3MO	1'140	230	220	1'150	GBP	106.14%	1'361'066.69	0.61 a)
GB00BNNGP551	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/31 3MO	1'350	70	430	990	GBP	130.62%	1'441'985.47	0.65 a)
GB00BNNGP882	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/51 3MO	1'265	70	380	955	GBP	96.27%	1'025'150.69	0.46 a)
GB00BP9DLZ64	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/58 3MO	1'270	70	390	950	GBP	104.07%	1'102'486.14	0.49 a)
GB00BPSNBG80	1.2500 % UKTI 1 1/4 11/22/54 3MO	0	740	20	720	GBP	100.29%	805'190.60	0.36 a)
GB00BYMVG366	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/46 3MO	1'568	90	490	1'168	GBP	118.03%	1'537'295.55	0.69 a)
GB00BYVP4K94	0.1250 % UKTI 0 1/8 11/22/56 3MO	840	40	270	610	GBP	102.27%	695'644.34	0.31 a)
GB00BYF5F144	0.1250 % UKTI 0 1/8 03/22/26 3MO	1'366	50	290	1'126	GBP	148.40%	1'863'252.83	0.83 a)
GB00BYZW3J87	0.1250 % UKTI 0 1/8 11/22/36 3MO	1'610	90	500	1'200	GBP	138.42%	1'852'237.18	0.83 a)
GB00BZ13DV40	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/48 3MO	1'363	70	420	1'013	GBP	107.12%	1'210'040.03	0.54 a)
GB00BZ1NTB69	0.1250 % UKTI 0 1/8 08/10/28 3MO	2'086	90	650	1'526	GBP	138.13%	2'350'368.05	1.05 a)
<b>GBP</b>							<b>51'924'870.78</b>	<b>23.23</b>	
IL0010977085	4.0000 % ILCPI 4 05/30/36 0536	1'820	90	600	1'310	ILS	163.34%	500'472.95	0.22 a)
IL0011205833	2.7500 % ILCPI 2 3/4 08/30/41 0841	2'080	280	700	1'660	ILS	133.83%	519'610.45	0.23 a)
IL0011348658	1.0000 % ILCPI 1 05/31/45 0545	2'070	120	700	1'490	ILS	93.56%	326'043.36	0.15 a)
IL0011359127	0.7500 % ILCPI 0 3/4 10/31/25 1025	2'520	160	900	1'780	ILS	114.20%	475'429.45	0.21 a)
IL0011408478	0.7500 % ILCPI 0 3/4 05/31/27 0527	2'600	330	1'000	1'930	ILS	113.09%	510'488.94	0.23 a)
IL0011570236	0.5000 % ILCPI 0 1/2 05/31/29 0529	2'340	390	600	2'130	ILS	107.97%	537'894.87	0.24 a)
IL0011683013	0.5000 % ILCPI 0 1/2 11/30/51 1151	2'010	410	500	1'920	ILS	75.53%	339'199.18	0.15 a)
IL0011695645	0.1000 % ILCPI 0.1 07/31/26 0726	2'360	200	800	1'760	ILS	111.42%	458'667.75	0.21 a)
IL0011722209	0.1000 % ILCPI 0.1 11/30/31 1131	3'520	300	1'200	2'620	ILS	100.55%	616'199.62	0.28 a)
IL0011973265	1.1000 % ILCPI 1.1 10/31/28 1028	1'070	570	0	1'640	ILS	100.95%	387'211.98	0.17 a)
IL0012043795	1.6000 % ILCPI 1.6 10/31/33 1033	0	820	0	820	ILS	98.95%	189'785.71	0.08 a)
<b>ILS</b>							<b>4'861'004.26</b>	<b>2.17</b>	
MX05GO000015	4.5000 % MUDI 4 1/2 12/04/25 S	37'900	0	9'500	28'400	MXN	805.34%	987'835.66	0.44 a)
MX05GO000023	4.5000 % MUDI 4 1/2 11/22/35 S	57'400	0	13'500	43'900	MXN	775.56%	1'470'502.96	0.66 a)
MX05GO000098	4.0000 % MUDI 4 11/15/40 S	54'100	5'000	19'000	40'100	MXN	714.87%	1'238'111.48	0.55 a)
MX05GO0000E3	4.0000 % MUDI 4 11/08/46 S	48'600	3'000	14'500	37'100	MXN	696.56%	1'116'142.31	0.50 a)
MX05GO0000F0	4.0000 % MUDI 4 11/30/28 S	54'450	3'000	17'000	40'450	MXN	786.19%	1'373'508.24	0.61 a)
MX05GO0000H6	4.0000 % MUDI 4 11/03/50 S	77'800	3'000	23'000	57'800	MXN	685.46%	1'711'171.51	0.77 a)
MX05GO0000K0	2.7500 % MUDI 2 3/4 11/27/31 S	66'000	5'000	19'000	52'000	MXN	702.74%	1'578'267.89	0.71 a)
MX05GO0000M6	3.0000 % MUDI 3 12/03/26 S	42'200	4'500	12'000	34'700	MXN	772.66%	1'157'983.43	0.52 a)
MX05GO0000N4	3.2500 % MUDI 3 1/4 11/12/43 S	19'600	0	0	19'600	MXN	626.15%	530'052.91	0.24 a)
MX05GO0000P9	4.0000 % MUDI 4 08/24/34 S	0	8'700	0	8'700	MXN	744.61%	279'791.29	0.13 a)
MX05GO0000Q7	4.0000 % MUDI 4 10/29/54 S	0	9'100	0	9'100	MXN	679.16%	266'930.82	0.12 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.
<b>MXN</b>							<b>11'710'298.50</b>	<b>5.24</b>	
NZIBDT002C2	2.0000 % NZGBI 2 09/20/25 0925	350	0	100	250 NZD	132.69%	176'089.46	0.08	a)
NZIBDT003C0	3.0000 % NZGBI 3 09/20/30 0930	450	0	130	320 NZD	138.10%	234'587.40	0.10	a)
NZIBDT004C8	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/35 0935	760	0	230	530 NZD	129.84%	365'306.38	0.16	a)
NZIBDT005C5	2.5000 % NZGBI 2 1/2 09/20/40 0940	510	0	140	370 NZD	124.49%	244'509.27	0.11	a)
<b>NZD</b>							<b>1'020'492.51</b>	<b>0.46</b>	
SE0000556599	3.5000 % SGBI 3 1/2 12/01/28 #3104 3104	3'220	0	980	2'240 SEK	180.98%	335'865.90	0.15	a)
SE0005703550	1.0000 % SGBI 1 06/01/25 #3109 3109	4'120	0	4'120	0 SEK	0.00%	0.00	0.00	
SE0007045745	0.1250 % SGBI 0 1/8 06/01/32 #3111 3111	2'920	0	840	2'080 SEK	129.19%	222'624.67	0.10	a)
SE0008014062	0.1250 % SGBI 0 1/8 06/01/26 #3112 3112	3'910	0	1'200	2'710 SEK	129.88%	291'610.21	0.13	a)
SE0009548704	0.1250 % SGBI 0 1/8 12/01/27 #3113 3113	3'030	0	690	2'340 SEK	127.52%	247'219.01	0.11	a)
SE0013748258	0.1250 % SGBI 0 1/8 06/01/30 #3114 3114	2'500	0	680	1'820 SEK	120.09%	181'080.94	0.08	a)
<b>SEK</b>							<b>1'278'400.73</b>	<b>0.57</b>	
US912810FD55	3.6250 % TII 3 5/8 04/15/28	971	20	300	691 USD	206.42%	1'210'171.56	0.54	a)
US912810FH69	3.8750 % TII 3 7/8 04/15/29	1'149	30	360	819 USD	209.27%	1'454'144.91	0.65	a)
US912810FS25	2.0000 % TII 2 01/15/26	1'289	0	400	889 USD	157.05%	1'184'617.06	0.53	a)
US912810PS15	2.3750 % TII 2 3/8 01/15/27	1'263	30	390	903 USD	157.10%	1'203'648.78	0.54	a)
US912810PV44	1.7500 % TII 1 3/4 01/15/28	1'233	40	380	893 USD	149.73%	1'134'458.23	0.51	a)
US912810PZ57	2.5000 % TII 2 1/2 01/15/29	1'167	60	360	867 USD	151.22%	1'112'412.60	0.50	a)
US912810QF84	2.1250 % TII 2 1/8 02/15/40	706	30	220	516 USD	148.76%	651'283.74	0.29	a)
US912810QP66	2.1250 % TII 2 1/8 02/15/41	1'041	50	320	771 USD	147.09%	962'225.36	0.43	a)
US912810QV35	0.7500 % TII 0 3/4 02/15/42	1'741	90	540	1'291 USD	113.10%	1'238'825.65	0.55	a)
US912810RA88	0.6250 % TII 0 5/8 02/15/43	1'394	80	440	1'034 USD	106.71%	936'201.93	0.42	a)
US912810RF75	1.3750 % TII 1 3/8 02/15/44	1'935	70	600	1'405 USD	120.12%	1'431'942.34	0.64	a)
US912810RL44	0.7500 % TII 0 3/4 02/15/45	2'154	110	670	1'594 USD	104.15%	1'408'536.86	0.63	a)
US912810RR14	1.0000 % TII 1 02/15/46	1'121	60	350	831 USD	107.94%	761'036.75	0.34	a)
US912810RW09	0.8750 % TII 0 7/8 02/15/47	1'403	70	440	1'033 USD	102.03%	894'200.44	0.40	a)
US912810SB52	1.0000 % TII 1 02/15/48	1'033	50	320	763 USD	101.96%	660'070.05	0.30	a)
US912810SG40	1.0000 % TII 1 02/15/49	989	70	310	749 USD	99.34%	631'265.40	0.28	a)
US912810SM18	0.2500 % TII 0 1/4 02/15/50	1'526	50	470	1'106 USD	78.71%	738'557.21	0.33	a)
US912810SV17	0.1250 % TII 0 1/8 02/15/51	1'560	60	490	1'130 USD	73.76%	707'180.18	0.32	a)
US912810TE82	0.1250 % TII 0 1/8 02/15/52	1'940	130	610	1'460 USD	68.02%	842'529.20	0.38	a)
US912810TP30	1.5000 % TII 1 1/2 02/15/53	1'980	100	620	1'460 USD	93.21%	1'154'580.31	0.52	a)
US912810TY47	2.1250 % TII 2 1/8 02/15/54	0	1'700	230	1'470 USD	104.02%	1'297'303.43	0.58	a)
US9128282L36	0.3750 % TII 0 3/8 07/15/27	3'397	60	1'050	2'407 USD	123.62%	2'524'525.14	1.13	a)
US9128283R96	0.5000 % TII 0 1/2 01/15/28	3'498	90	1'080	2'508 USD	122.01%	2'596'342.98	1.16	a)
US9128285W63	0.8750 % TII 0 7/8 01/15/29	2'672	150	830	1'992 USD	120.17%	2'030'930.33	0.91	a)
US9128287D64	0.2500 % TII 0 1/4 07/15/29	3'205	170	1'000	2'375 USD	115.24%	2'322'197.07	1.04	a)
US912828N712	0.6250 % TII 0 5/8 01/15/26	3'228	50	1'010	2'268 USD	128.81%	2'478'712.94	1.11	a)
US9128285505	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/26	3'242	110	1'000	2'352 USD	126.66%	2'527'667.58	1.13	a)
US912828V491	0.3750 % TII 0 3/8 01/15/27	3'048	70	950	2'168 USD	125.20%	2'303'034.85	1.03	a)
US912828XL95	0.3750 % TII 0 3/8 07/15/25	3'825	0	2'790	1'035 USD	129.84%	1'140'145.58	0.51	a)
US912828Y388	0.7500 % TII 0 3/4 07/15/28	3'103	50	960	2'193 USD	121.01%	2'251'649.50	1.01	a)
US912828Z377	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/30	3'647	190	1'140	2'697 USD	112.61%	2'576'803.06	1.15	a)
US912828ZJ22	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/25	3'040	0	3'040	0 USD	118.84%	0.00	0.00	
US912828ZZ63	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/30	4'020	190	1'250	2'960 USD	112.56%	2'826'865.44	1.26	a)
US91282CAQ42	0.1250 % TII 0 1/8 10/15/25	3'710	200	1'150	2'760 USD	117.96%	2'762'303.47	1.24	a)
US91282CBF77	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/31	4'220	220	1'310	3'130 USD	109.54%	2'909'082.88	1.30	a)
US91282CCA71	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/26	2'900	50	900	2'050 USD	115.51%	2'009'117.16	0.90	a)
US91282CCM10	0.1250 % TII 0 1/8 07/15/31	4'440	230	1'380	3'290 USD	105.77%	2'952'515.39	1.32	a)
US91282CDC29	0.1250 % TII 0 1/8 10/15/26	4'180	180	1'300	3'060 USD	110.79%	2'876'322.00	1.29	a)
US91282CDX65	0.1250 % TII 0 1/8 01/15/32	5'020	250	1'560	3'710 USD	100.99%	3'179'006.65	1.42	a)
US91282CEJ62	0.1250 % TII 0 1/8 04/15/27	4'410	130	1'370	3'170 USD	106.11%	2'853'873.98	1.28	a)
US91282CEZ05	0.6250 % TII 0 5/8 07/15/32	5'460	290	1'700	4'050 USD	99.78%	3'428'822.25	1.53	a)
US91282CFR79	1.6250 % TII 1 5/8 10/15/27	4'640	190	1'440	3'390 USD	105.81%	3'043'310.21	1.36	a)
US91282CGK18	1.1250 % TII 1 1/8 01/15/33	5'460	280	1'700	4'040 USD	100.35%	3'439'590.09	1.54	a)
US91282CGW55	1.2500 % TII 1 1/4 04/15/28	4'640	120	1'440	3'320 USD	102.71%	2'893'264.54	1.29	a)
US91282CHP95	1.3750 % TII 1 3/8 07/15/33	5'440	280	1'690	4'030 USD	100.49%	3'435'909.37	1.54	a)
US91282CJH51	2.3750 % TII 2 3/8 10/15/28	4'880	190	1'520	3'550 USD	105.54%	3'178'770.90	1.42	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.
US91282CJY84	1.7500 % Til 1 3/4 01/15/34	2'090	2'550	330	4'310 USD	101.90%	3'726'393.42	1.67	a)
US91282CKL45	2.1250 % Til 2 1/8 04/15/29	0	3'780	0	3'780 USD	103.44%	3'317'618.34	1.48	a)
US91282CLE92	1.8750 % Til 1 7/8 07/15/34	0	1'640	0	1'640 USD	101.16%	1'407'550.63	0.63	a)
<b>USD</b>							<b>94'607'517.74</b>	<b>42.33</b>	

### Derivative Finanzinstrumente

**-1'100.27 0.00**

#### Devisentermingeschäfte

USD/EUR	Verfall 05.08.2024		535'896	580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.09.2024		1'140'000	1'070'613	EUR/CHF		-353.22	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 04.09.2024		830'000	925'487	GBP/CHF		-461.02	0.00	b)
CHF/MXN	Verfall 04.09.2024		4'960'000	214'234	MXN/CHF		-286.03	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 04.09.2024		2'510'000	2'129'461	USD/CHF		0.00	0.00	
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-1'100.27</b>	<b>0.00</b>	

#### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

MXN/CHF	Verfall 03.04.2024		17'743'053	346'674'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024		4'867'281	7'518'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.04.2024		2'240'070	26'373'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 03.04.2024		1'414'329	2'645'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024		65'240'060	58'749'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.04.2024		123'559'981	140'773'000	CHF/USD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 03.04.2024		6'160'797	25'050'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.04.2024		3'487'880	6'097'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		62'144'075	65'345'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.04.2024		12'169	21'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024		313'921	328'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 03.04.2024		13'166	255'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.04.2024		1'060'433	1'202'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024		28'654	44'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024		1'224'824	1'097'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.04.2024		59'846'000	68'089'188	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 03.04.2024		346'929'000	18'800'325	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.04.2024		6'118'000	3'594'876	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.04.2024		7'562'000	5'032'889	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.04.2024		141'975'000	127'883'981	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 03.04.2024		26'373'000	2'221'398	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 03.04.2024		2'645'000	1'424'941	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024		65'673'000	63'886'694	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 03.04.2024		25'050'000	6'158'793	ILS/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024		68'020'341	59'976'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 03.05.2024		18'388'227	342'083'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.05.2024		3'631'587	6'196'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.05.2024		5'024'878	7'572'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		125'550'152	139'854'000	CHF/USD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.05.2024		2'233'633	26'576'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'437'920	2'678'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		62'024'346	63'895'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'400'236	1'550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024		632'385	557'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		526'762	541'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 03.05.2024		2'678'000	1'453'485	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 03.05.2024		26'576'000	2'220'425	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.05.2024		6'196'000	3'690'214	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 03.05.2024		24'952'000	6'131'555	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.05.2024		141'404'000	129'695'749	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.05.2024		60'533'000	69'519'729	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 03.05.2024		342'083'000	18'414'602	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.05.2024		7'572'000	5'055'143	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.05.2024		64'436'000	63'195'607	EUR/CHF		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 06.05.2024		6'108'608	24'909'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 06.05.2024		10'465	43'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.06.2024		2'218'536	26'612'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.06.2024		3'361'463	5'659'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.06.2024		126'181'516	138'072'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.06.2024		67'155'856	58'676'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.06.2024		17'666'725	331'093'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.06.2024		4'900'963	7'364'000	CHF/CAD		0.00	0.00	

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.
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		62'761'167	64'143'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		65'000	43'195	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		170'000	165'642	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		575'000	523'590	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		13'700	23'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 04.06.2024		68'732	1'285'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		487'000	553'822	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		533'000	44'994	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		319'000	313'292	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		265'000	303'128	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		858'000	774'753	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		98'000	65'008	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		3'695'000	198'714	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		135'000	156'656	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		59'000	53'847	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		60'000	59'227	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		901'000	595'608	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		41'258'000	2'196'167	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		7'868'000	7'708'492	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		937'000	562'427	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		17'501'000	15'813'939	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		7'078'000	8'147'627	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		55'726'000	54'578'044	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.06.2024		2'652'000	1'470'030	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		4'745'000	2'847'000	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		50'711'000	58'249'697	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		6'300'000	4'169'655	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		119'079'000	107'433'074	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		26'079'000	2'237'317	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 04.06.2024		287'425'000	15'205'875	MXN/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		1'429'701	2'644'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.06.2024		6'055'617	24'704'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.06.2024		4'318	8'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		7'682'000	1'873'793	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 05.06.2024		17'022'000	4'128'005	ILS/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		44'732'388	45'764'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		2'463'677	4'116'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		47'626'789	41'590'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		89'640'826	99'679'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.07.2024		12'886'757	245'477'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		1'599'501	18'679'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		690'922	605'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		722'299	808'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		1'792	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 02.07.2024		122'340	2'412'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		274'339	282'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		2'575	30'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		100'487'000	90'293'599	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.07.2024		42'195'000	47'928'879	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/MXN Verfall 02.07.2024		247'889'000	12'182'554	MXN/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.07.2024		18'709'000	1'587'646	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.07.2024		4'119'000	2'472'059	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		5'282'000	3'468'256	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		46'046'000	44'346'903	EUR/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		1'050'380	1'901'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		4'048'125	16'730'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		3'453'685	5'232'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.07.2024		4'879	20'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		32'803	50'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.07.2024		6'073	11'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.07.2024		1'912'000	1'046'757	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.07.2024		16'750'000	3'995'210	ILS/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.08.2024		1'046'941	1'920'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		91'900'127	102'698'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		47'818'312	42'262'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.08.2024		11'710'011	240'530'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		1'310'502	15'481'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		44'002'666	45'804'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.08.2024		121'000	117'093	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.08.2024		196'000	223'220	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		415'142	461'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	MXN/CHF Verfall 05.08.2024		99'069	2'037'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		1'327'996	1'164'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		1'280'795	1'323'000	CHF/EUR		0.00	0.00	

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.
MXN/CHF	Verfall 05.08.2024		328'510	6'688'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.08.2024		2'170'441	2'412'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.08.2024		550'903	616'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		518'045	534'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.08.2024		389'082	339'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.08.2024		794'204	900'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.08.2024		296'107	309'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 05.08.2024		349'885	7'330'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.08.2024		493'414	435'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 05.08.2024		256'585'000	12'122'461	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 05.08.2024		15'481'000	1'271'300	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.08.2024		107'087'000	94'259'048	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.08.2024		44'004'000	49'750'482	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.08.2024		47'849'000	45'576'173	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 05.08.2024		1'920'000	1'003'776	NZD/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.08.2024		2'456'717	4'107'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 06.08.2024		4'007'164	16'849'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 06.08.2024		3'475'635	5'311'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 06.08.2024		515'306	2'151'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.08.2024		23'000	15'094	CAD/CHF		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.08.2024		22'173	37'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 06.08.2024		147'298	231'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.08.2024		5'519'000	3'516'486	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 06.08.2024		19'000'000	4'447'150	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.08.2024		4'144'000	2'381'847	AUD/CHF		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.09.2024		3'608'131	5'678'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.09.2024		12'479'166	266'362'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.09.2024		1'281'626	15'640'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.09.2024		4'482'979	19'191'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.09.2024		2'386'884	4'164'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.09.2024		94'540'512	107'794'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.09.2024		51'347'721	45'567'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.09.2024		47'240'378	49'705'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 04.09.2024		1'011'162	1'941'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.09.2024		30'165	54'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.09.2024		20'406	33'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.09.2024		543'668	635'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.09.2024		172'299	184'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.09.2024		404'728	369'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
MXN/CHF	Verfall 04.09.2024		21'081	471'000	CHF/MXN		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 04.09.2024		315'447	1'370'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.09.2024		191'477	335'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 04.09.2024		45'936'000	51'215'195	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.09.2024		108'429'000	91'981'513	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 04.09.2024		49'889'000	46'847'467	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 04.09.2024		5'711'000	3'595'114	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/MXN	Verfall 04.09.2024		266'833'000	11'523'984	MXN/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 04.09.2024		4'553'000	2'620'670	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 04.09.2024		1'941'000	1'030'190	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 04.09.2024		15'640'000	1'295'697	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 04.09.2024		20'561'000	4'808'807	ILS/CHF		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.10.2024		51'702'725	46'515'000	CHF/GBP		0.00	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 02.10.2024		94'827'725	112'155'000	CHF/USD		0.00	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 02.10.2024		47'678'007	50'877'000	CHF/EUR		0.00	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 02.10.2024		3'559'362	5'668'000	CHF/CAD		0.00	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 02.10.2024		2'635'592	4'591'000	CHF/AUD		0.00	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 02.10.2024		1'033'207	1'953'000	CHF/NZD		0.00	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 02.10.2024		1'292'708	15'633'000	CHF/SEK		0.00	0.00	b)
ILS/CHF	Verfall 02.10.2024		4'875'507	20'899'000	CHF/ILS		0.00	0.00	b)
MXN/CHF	Verfall 03.10.2024		11'704'354	273'179'000	CHF/MXN		0.00	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

## Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	3'825'837.21	1.71
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	219'066'533.09	98.01
Derivative Finanzinstrumente	-1'100.27	0.00
Sonstige Vermögenswerte	626'639.45	0.28
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>223'517'909.48</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-2'152'249.99	
Andere Verbindlichkeiten	-467.58	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>221'365'191.91</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);	219'066'533.09	98.01
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-1'100.27	0.00
c)	Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57567333
CAD	1 = CHF	0.62953070
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
ILS	1 = CHF	0.23389387
MXN	1 = CHF	0.04319021
NZD	1 = CHF	0.53083274
SEK	100 = CHF	8.28503800
USD	1 = CHF	0.84845000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	2'210'370.95	0.999
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	220'036'770.99	99.400

## 5 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 Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
FAH1 CHF	CHF	0.00 - 0.30	-	0.245	-	-	-
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.30	-	0.245	-	-	-
STH1 CHF	CHF	0.00 - 0.30	-	0.245	-	-	-

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

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.03.2024 - 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
FAH1 CHF	0.250	0.550	0.150	0.100	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	3.000
STH1 CHF	-	-	-	-	3.000

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

## 8 Benchmark

FTSE Non-JPY World Inflation-Linked Securities Index TR

## 9 TER

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

## 10 Fussnoten

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



## 11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens, berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten, aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter 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 Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen

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

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