

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND WORLD (EX CH) RESPONSIBLE

Halbjahresbericht per 31.08.2024

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

Klasse	Valor	Währung
FA CHF	56317036	CHF
GT USD	55176721	USD
NA CHF	115989480	CHF
NT CHF	45146175	CHF
NTH1 CHF	52089277	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	16
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	17
7	Pauschale Verwaltungskommission	17
8	Benchmark	17
9	TER	17
10	Fussnoten	18
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19

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
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'408'137'889.91	1'180'749'113.24	641'132'374.13	657'216'154.41
Klasse FA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		25'999'310.51	17'597'594.87	11'003'381.65	6'244'740.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		184'457.046	133'297.769	96'496.457	51'373.131
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		140.9505	132.0172	114.0289	121.5566
Ausschüttung je Anteil		-	-	1.80	1.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.25 %	0.25 %	0.25 %	0.27 %
Klasse GT USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		70'115'410.40	64'892'439.61	39'656'575.66	28'681'690.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		473'313.008	467'665.890	334'362.736	228'718.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		174.5978	157.5812	126.5441	136.6854
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in CHF		148.1375	138.7581	118.6035	125.4020
Thesaurierung je Anteil (in CHF)		-	0.09	1.78	1.58
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.22 %	0.22 %	0.22 %	0.22 %
Klasse NA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		262'764'799.69	226'440'609.42		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'198'515.148	2'025'336.049		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		119.5192	111.8040		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		140.8677	126.9706		
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %		
Klasse NT CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		663'347'769.89	562'423'102.76	498'741'464.73	545'525'757.86
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'804'744.054	3'445'541.743	3'579'891.040	3'708'342.309
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		174.3475	163.2321	139.3175	147.1077
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		205.4895	185.3752	148.6450	160.3441
Thesaurierung je Anteil		-	0.42	2.40	2.19
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		385'910'599.42	309'395'366.58	91'730'952.09	76'763'964.70
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'531'327.772	2'192'002.401	780'071.459	603'974.683
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		152.4538	141.1474	117.5930	127.0980
Thesaurierung je Anteil		-	0.37	2.02	1.89
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse FA CHF (Lancierung 02.09.2020)	6.77 %	13.18 %	-17.13 %	25.38 %
Klasse GT USD	10.82 %	24.44 %	-18.37 %	21.74 %
Klasse NA CHF (Lancierung 19.09.2023)	6.90 %	1.06 %	-	-
Klasse NT CHF	6.90 %	13.45 %	-16.93 %	25.76 %
Klasse NTH1 CHF	8.10 %	19.28 %	-18.15 %	22.86 %
Benchmark Hedge	7.76 %	18.56 %	-18.11 %	-
Benchmark	6.52 %	12.82 %	-16.87 %	25.65 %
Tracking Error 33)	-	0.56 %	0.48 %	0.47 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

Tracking Differenz

Klasse	
Klasse FA CHF (Lancierung 02.09.2020)	0.25 %
Klasse GT USD	4.30 %
Klasse NA CHF (Lancierung 19.09.2023)	0.38 %
Klasse NT CHF	0.38 %
Klasse NTH1 CHF	0.34 %

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	22'518'500.88	5'296'160.06
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	85'447'462.26	72'748'996.79
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'293'538'842.58	1'105'073'929.18
Sonstige Vermögenswerte	6'829'898.98	309'093.78
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'408'334'704.70	1'183'428'179.81
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-2'566'508.84
Andere Verbindlichkeiten	-196'814.79	-112'557.73
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'408'137'889.91	1'180'749'113.24

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		133'297.769	96'496.457
Ausgegebene Anteile		66'205.075	55'397.269
Zurückgenommene Anteile		-15'045.798	-18'595.957
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		184'457.046	133'297.769
Klasse GT USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		467'665.890	334'362.736
Ausgegebene Anteile		140'570.781	206'304.052
Zurückgenommene Anteile		-134'923.663	-73'000.898
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		473'313.008	467'665.890
Klasse NA CHF			
			<i>Lancierung</i>
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'025'336.049	-
Ausgegebene Anteile		173'179.099	2'025'436.049
Zurückgenommene Anteile		-	-100.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'198'515.148	2'025'336.049
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'445'541.743	3'579'891.040
Ausgegebene Anteile		549'843.810	869'297.703
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		179'164.006	-
Zurückgenommene Anteile		-369'805.505	-1'003'647.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'804'744.054	3'445'541.743
Klasse NTH1 CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'192'002.401	780'071.459
Ausgegebene Anteile		385'105.897	1'556'632.750
Zurückgenommene Anteile		-45'780.526	-144'701.808
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'531'327.772	2'192'002.401

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	26.06.2024	31'701'189.64	179'164.006

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'180'749'113.24	641'132'374.13
Ausbezahlte Ausschüttung		0.00	-186'995.44
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-822'716.43	-4'005'492.43
Saldo aus dem Anteilverkehr		140'142'730.49	373'846'051.31
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		88'068'762.61	169'963'175.67
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'408'137'889.91	1'180'749'113.24

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2023 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		150'070.52	280'829.47
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'200.88	-2'829.58
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		1'298'034.27	2'055'171.92
Erträge der Gratisaktien		0.00	85'667.07
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		18'353'770.59	0.00
Sonstige Erträge		18'949.80	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'287'400.65	640'779.14
Total Ertrag		22'107'024.95	3'059'618.02
Aufwand			
Passivzinsen		-0.47	-188.85
Reglementarische Vergütungen		-105'464.89	-141'537.20
Sonstige Aufwendungen		-5'717.79	-49.96
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-629'664.57	-380'329.12
Total Aufwand		-740'847.72	-522'105.13
Nettoertrag / Verlust		21'366'177.23	2'537'512.89
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-2'404'341.40	33'547'754.21
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		12'641.14	148'226.34
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		161'429.03	472'512.39
Realisierter Erfolg		19'135'906.00	36'706'005.83
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		68'932'856.61	133'257'169.84
Gesamterfolg		88'068'762.61	169'963'175.67

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.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							85'447'462.26	6.07	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							85'447'462.26	6.07	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	14'181	3'674	0	17'855 AUD	54.71	562'344.79	0.04	a)
AU000000ANZ3	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	64'459	7'232	1'003	70'688 AUD	30.40	1'237'073.17	0.09	a)
AU000000APA1	APA GROUP	12'794	24'564	0	37'358 AUD	7.59	163'230.57	0.01	a)
AU000000AZJ1	AURIZON HOLDINGS LTD	7'104	0	7'104	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000BSL0	BLUESCOPE STEEL LTD	14'063	11'777	0	25'840 AUD	20.66	307'325.74	0.02	a)
AU000000BxB1	BRAMBLES LTD	51'215	0	0	51'215 AUD	18.23	537'477.09	0.04	a)
AU000000CAR3	CAR GROUP LTD	6'588	0	0	6'588 AUD	37.86	143'585.41	0.01	a)
AU000000CBA7	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	43'628	3'564	248	46'944 AUD	139.50	3'769'905.03	0.27	a)
AU000000CPUS	COMPUTERSHARE LTD	17'888	3'603	0	21'491 AUD	28.43	351'730.15	0.02	a)
AU000000CSL8	CSL LTD	12'630	1'857	0	14'487 AUD	307.16	2'561'646.68	0.18	a)
AU000000DXS1	DEXUS/AU	19'298	0	0	19'298 AUD	7.22	80'209.46	0.01	a)
AU000000FMG4	FORTESCUE LTD	72'383	16'576	1'182	87'777 AUD	18.27	923'199.14	0.07	a)
AU000000GMG2	GOODMAN GROUP	39'134	15'882	1'799	53'217 AUD	33.40	1'023'229.29	0.07	a)
AU000000GPT8	GPT GROUP	13'690	0	0	13'690 AUD	4.92	38'774.36	0.00	a)
AU000000IEL5	IDP EDUCATION LTD	5'033	0	5'033	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000MGR9	MIRVAC GROUP	67'932	0	0	67'932 AUD	2.04	79'777.55	0.01	a)
AU000000MIN4	MINERAL RESOURCES LTD	8'531	2'632	0	11'163 AUD	40.15	258'013.59	0.02	a)
AU000000MQG1	MACQUARIE GROUP LTD	9'872	2'014	1'050	10'836 AUD	215.65	1'345'223.88	0.10	a)
AU000000NAB4	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	77'514	4'974	838	81'650 AUD	38.17	1'794'132.27	0.13	a)
AU000000NST8	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	49'818	5'581	0	55'399 AUD	15.26	486'667.75	0.03	a)
AU000000ORG5	ORIGIN ENERGY LTD	37'693	0	0	37'693 AUD	9.96	216'120.59	0.02	a)
AU000000ORI1	ORICA LTD	39'262	1'280	1'928	38'614 AUD	17.76	394'787.93	0.03	a)
AU000000PLS0	PILBARA MINERALS LTD	190'349	18'693	0	209'042 AUD	2.97	357'409.52	0.03	a)
AU000000REA9	REA GROUP LTD	977	0	0	977 AUD	219.00	123'172.79	0.01	a)
AU000000RHC8	RAMSAY HEALTH CARE LTD	5'045	1'709	0	6'754 AUD	41.55	161'550.46	0.01	a)
AU000000S320	SOUTH32 LTD	182'563	29'515	84'341	127'737 AUD	3.14	230'899.22	0.02	a)
AU000000SCG8	SCENTRE GROUP	12'842	0	0	12'842 AUD	3.44	25'431.22	0.00	a)
AU000000SEK6	SEEK LTD	938	0	0	938 AUD	23.05	12'446.58	0.00	a)
AU000000SGP0	STOCKLAND	51'029	0	0	51'029 AUD	5.02	147'467.69	0.01	a)
AU000000SHL7	SONIC HEALTHCARE LTD	14'074	5'061	0	19'135 AUD	27.68	304'909.29	0.02	a)
AU000000STO6	SANTOS LTD	0	69'273	0	69'273 AUD	7.22	287'923.63	0.02	a)
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	0	60'382	0	60'382 AUD	17.67	614'214.62	0.04	a)
AU000000SVW5	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	0	419	0	419 AUD	41.08	9'908.79	0.00	a)
AU000000TCL6	TRANSURBAN GROUP	86'244	2'973	0	89'217 AUD	13.55	695'925.93	0.05	a)
AU000000TLS2	TELSTRA GROUP LTD	157'909	0	0	157'909 AUD	3.93	357'252.72	0.03	a)
AU000000TWE9	TREASURY WINE ESTATES LTD	14'899	0	0	14'899 AUD	11.43	98'034.62	0.01	a)
AU000000VCX7	VICINITY CENTRES	49'975	0	49'975	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000WBC1	WESTPAC BANKING CORP	74'350	0	0	74'350 AUD	31.24	1'337'112.99	0.09	a)
AU000000WES1	WESFARMERS LTD	27'772	2'563	493	29'842 AUD	72.60	1'247'213.08	0.09	a)
AU000000WOW2	WOOLWORTHS GROUP LTD	51'836	0	7'479	44'357 AUD	35.68	911'093.86	0.06	a)
AU000000WTC3	WISETECH GLOBAL LTD	3'370	0	0	3'370 AUD	118.87	230'610.07	0.02	a)
AU0000030678	COLES GROUP LTD	0	20'708	0	20'708 AUD	18.79	223'996.40	0.02	a)
AU0000088338	AMPOL LTD	13'190	0	13'190	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	12'071	34'982	0	47'053 AUD	5.34	144'645.42	0.01	a)
AU0000219529	LOTTERY CORP LTD/THE	75'513	0	75'513	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000224040	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	50'114	5'968	0	56'082 AUD	27.19	877'826.75	0.06	a)
AU							24'673'500.09	1.75	
CA0084741085	AGNICO EAGLE MINES LTD	12'845	0	0	12'845 CAD	109.80	887'878.14	0.06	a)
CA0089118776	AIR CANADA	2'127	0	2'127	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	20'461	901	0	21'362 CAD	76.93	1'034'557.32	0.07	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	11'279	5'290	0	16'569 CAD	34.52	360'067.56	0.03	a)
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	15'635	5'673	0	21'308 CAD	112.71	1'511'896.47	0.11	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	28'528	14'100	0	42'628 CAD	67.27	1'805'233.14	0.13	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.
CA11271J1075	BROOKFIELD CORP	35'745	3'708	433	39'020 CAD	67.80	1'665'458.72	0.12	a)
CA13321L1085	CAMECO CORP	0	19'590	0	19'590 CAD	54.99	678'164.53	0.05	a)
CA1349211054	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1'192	0	685	507 CAD	52.38	16'718.23	0.00	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26'936	7'857	0	34'793 CAD	78.76	1'725'100.89	0.12	a)
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	9'768	4'573	0	14'341 CAD	158.79	1'433'571.96	0.10	a)
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	21'478	57'139	24'475	54'142 CAD	48.78	1'662'620.02	0.12	a)
CA13646K1084	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	21'868	0	2'698	19'170 CAD	111.87	1'350'058.74	0.10	a)
CA1366812024	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	946	1'538	0	2'484 CAD	153.64	240'255.20	0.02	a)
CA15135U1093	CENOVUS ENERGY INC	44'682	0	44'682	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA21037X1006	CONSTELLATION SOFTWARE INC	695	40	8	727 CAD	4'400.69	2'014'058.59	0.14	a)
CA2908761018	EMERA INC	351	676	300	727 CAD	50.75	23'226.69	0.00	a)
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	71'351	2'980	1'746	72'585 CAD	54.22	2'477'555.02	0.18	a)
CA3359341052	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4'765	9'852	0	14'617 CAD	16.97	156'155.40	0.01	a)
CA33767E2024	FIRSTSERVICE CORP	1'608	281	0	1'889 CAD	242.93	288'888.35	0.02	a)
CA3495531079	FORTIS INC	2'014	1'489	1'755	1'748 CAD	59.30	65'254.89	0.00	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	6'526	1'000	0	7'526 CAD	164.56	779'660.27	0.06	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	4'862	2'200	0	7'062 CAD	61.42	273'057.71	0.02	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	27'276	0	1'739	25'537 CAD	45.81	736'456.47	0.05	a)
CA4530384086	IMPERIAL OIL LTD	8'701	4'083	0	12'784 CAD	101.50	816'863.93	0.06	a)
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	5'071	9'206	0	14'277 CAD	17.97	161'510.94	0.01	a)
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	50'290	0	6'706	43'584 CAD	12.18	334'188.34	0.02	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	5'142	631	0	5'773 CAD	175.88	639'197.29	0.05	a)
CA5503721063	LUNDIN MINING CORP	6'205	2'854	0	9'059 CAD	13.98	79'726.80	0.01	a)
CA5527041084	MEG ENERGY CORP	18'128	2'468	0	20'596 CAD	26.84	348'002.46	0.02	a)
CA5592224011	MAGNA INTERNATIONAL INC	5'540	4'516	0	10'056 CAD	56.64	358'562.96	0.03	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	55'129	0	55'129 CAD	37.21	1'291'387.86	0.09	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	14'981	1'598	200	16'379 CAD	123.49	1'273'315.68	0.09	a)
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	261	1'508	1'769	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	8'109	3'194	0	11'303 CAD	65.27	464'434.27	0.03	a)
CA6979001089	PAN AMERICAN SILVER CORP	15'617	0	1'982	13'635 CAD	27.22	233'646.98	0.02	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	25'521	5'231	30'752	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	14'025	814	1'182	13'657 CAD	93.63	804'984.00	0.06	a)
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	957	0	957	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11'244	0	0	11'244 CAD	54.63	386'695.35	0.03	a)
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	35'891	0	0	35'891 CAD	162.98	3'682'449.39	0.26	a)
CA82509L1076	SHOPIFY INC - CLASS A	28'976	2'942	540	31'378 CAD	99.81	1'971'588.28	0.14	a)
CA85472N1096	STANTEC INC	4'785	3'711	0	8'496 CAD	110.37	590'313.15	0.04	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	25'555	0	25'555	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	35'343	4'174	0	39'517 CAD	54.66	1'359'785.82	0.10	a)
CA87807B1076	TC ENERGY CORP	14'636	1'354	0	15'990 CAD	62.42	628'331.95	0.04	a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	10'096	2'083	0	12'179 CAD	64.53	494'755.02	0.04	a)
CA87971M9969	TELUS CORP-W/I	8'944	11'882	0	20'826 CAD	21.78	285'549.01	0.02	a)
CA8849038085	THOMSON REUTERS CORP	7'301	0	71	7'230 CAD	230.82	1'050'578.84	0.07	a)
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	39'787	16'502	3'445	52'844 CAD	80.75	2'686'303.82	0.19	a)
CA92938W2022	WSP GLOBAL INC	5'690	331	0	6'021 CAD	224.66	851'552.24	0.06	a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2'299	967	0	3'266 CAD	119.25	245'183.64	0.02	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	2'121	1'144	358	2'907 CAD	219.19	401'127.73	0.03	a)
CA9628791027	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	18'499	0	1'372	17'127 CAD	83.29	898'030.47	0.06	a)
CA							43'523'960.53	3.09	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	20'877	2'760	350	23'287 AUD	111.55	1'495'406.37	0.11	a)
GB							1'495'406.37	0.11	
BMG2178K1009	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25'500	0	0	25'500 HKD	57.90	160'593.56	0.01	a)
BMG4587L1090	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	50'700	21'700	0	72'400 USD	3.75	230'354.18	0.02	a)
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	53'600	0	53'600	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0000069689	AIA GROUP LTD	274'400	22'200	0	296'600 HKD	55.45	1'788'883.53	0.13	a)
HK0000093390	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	36'000	67'000	103'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0003000038	HONG KONG & CHINA GAS	619'800	69'000	37'000	651'800 HKD	6.35	450'191.66	0.03	a)
HK0004000045	WHARF HOLDINGS LTD	14'000	30'000	44'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0006000050	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	9'000	0	8'500	500 HKD	54.45	2'961.26	0.00	a)
HK0011000095	HANG SENG BANK LTD	29'800	9'900	0	39'700 HKD	94.30	407'203.56	0.03	a)
HK0012000102	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	14'000	26'000	0	40'000 HKD	24.30	105'724.50	0.01	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.
HK0016000132	SUN HUNG KAI PROPERTIES	6'500	51'500	0	58'000 HKD	76.45	482'297.32	0.03	a)
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	20'500	0	2'500	18'000 HKD	66.20	129'610.40	0.01	a)
HK0066009694	MTR CORP	74'927	0	6'000	68'927 HKD	27.55	206'547.69	0.01	a)
HK0083000502	SINO LAND CO	272'047	0	98'000	174'047 HKD	8.36	158'264.02	0.01	a)
HK0101000591	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27'000	0	27'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0388045442	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34'400	1'100	300	35'200 HKD	240.40	920'420.95	0.07	a)
HK0669013440	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	30'000	8'000	0	38'000 HKD	105.10	434'405.87	0.03	a)
KYG217651051	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	75'000	3'500	0	78'500 HKD	43.05	367'580.26	0.03	a)
KYG217781014	CK ASSET HOLDINGS LTD	75'000	10'500	0	85'500 HKD	31.55	293'409.96	0.02	a)
KYG319891092	ESR GROUP LTD	30'200	0	30'200	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG8187G1055	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	24'000	0	0	24'000 HKD	18.34	47'876.23	0.00	a)
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	42'000	0	0	42'000 HKD	22.75	103'929.79	0.01	a)
HK							6'290'254.74	0.45	
AU000000JHX1	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	13'136	6'916	0	20'052 AUD	55.08	635'810.56	0.05	a)
IE							635'810.56	0.05	
IL0002730112	NICE LTD	1'889	0	0	1'889 ILS	64'780.00	286'214.57	0.02	a)
IL0002810146	ICL GROUP LTD	10'595	6'913	0	17'508 ILS	1'651.00	67'608.68	0.00	a)
IL0006046119	BANK LEUMI LE-ISRAEL	0	36'874	0	36'874 ILS	3'492.00	301'171.12	0.02	a)
IL0006625771	BANK HAPOALIM BM	51'148	2'856	0	54'004 ILS	3'608.00	455'733.86	0.03	a)
IL0006954379	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9'321	0	2'996	6'325 ILS	13'850.00	204'893.95	0.01	a)
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	1'559	970	0	2'529 USD	192.50	413'053.03	0.03	a)
IL0011334468	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1'847	0	354	1'493 USD	286.74	363'223.84	0.03	a)
IL0011741688	GLOBAL-E ONLINE LTD	1'032	1'013	2'045	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IL0011762130	MONDAY.COM LTD	978	124	119	983 USD	265.89	221'759.27	0.02	a)
US8816242098	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	29'589	0	0	29'589 USD	18.87	473'727.33	0.03	a)
IL							2'787'385.65	0.20	
US81141R1005	SEA LTD-ADR	0	10'572	0	10'572 USD	78.31	702'426.09	0.05	a)
KY							702'426.09	0.05	
KYG7800X1079	SANDS CHINA LTD	59'200	1'600	0	60'800 HKD	14.24	94'172.25	0.01	a)
MO							94'172.25	0.01	
NZAIAE000256	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	29'902	18'631	8'114	40'419 NZD	7.59	162'741.70	0.01	a)
NZMELE000257	MERIDIAN ENERGY LTD	60'184	1'542	0	61'726 NZD	6.34	207'737.59	0.01	a)
NZMRPE000152	MERCURY NZ LTD	32'498	0	0	32'498 NZD	6.25	107'818.76	0.01	a)
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	87'472	3'347	21'769	69'050 NZD	3.59	131'587.86	0.01	a)
NZXROE000152	XERO LTD	2'946	534	0	3'480 AUD	142.84	286'157.54	0.02	a)
NZ							896'043.45	0.06	
SG1H97877952	SEBMCORP MARINE LTD	1'738'735	0	1'738'735	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1J26887955	SINGAPORE EXCHANGE LTD	39'700	23'400	0	63'100 SGD	10.83	444'825.52	0.03	a)
SG1L01001701	DBS GROUP HOLDINGS LTD	79'200	11'970	500	90'670 SGD	36.36	2'145'948.87	0.15	a)
SG1M51904654	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	230'918	32'800	0	263'718 SGD	2.12	363'921.33	0.03	a)
SG1R50925390	SEBMCORP INDUSTRIES LTD	10'200	0	5'000	5'200 SGD	4.93	16'687.15	0.00	a)
SG1R89002252	CITY DEVELOPMENTS LTD	35'400	0	35'400	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1S03926213	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	149'000	0	149'000	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1T56930848	WILMAR INTERNATIONAL LTD	58'700	0	0	58'700 SGD	3.14	119'977.45	0.01	a)
SG1T75931496	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	375'900	93'000	240'800	228'100 SGD	3.13	464'730.85	0.03	a)
SG1U68934629	KEPPEL LTD	60'700	16'200	0	76'900 SGD	6.17	308'847.00	0.02	a)
SG1V61937297	SINGAPORE AIRLINES LTD	12'100	0	9'900	2'200 SGD	6.28	8'993.20	0.00	a)
SG2D18969584	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	102'400	0	102'400	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SGXE21576413	GENTING SINGAPORE LTD	0	273'400	0	273'400 SGD	0.81	143'260.44	0.01	a)
SGXE34184239	SEATRUM LTD	0	70'717	70'717	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SGXE62145532	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	112'800	21'200	0	134'000 SGD	2.71	236'377.41	0.02	a)
SG							4'253'569.22	0.30	
CA11284V1058	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1'578	3'537	1'192	3'923 CAD	38.44	94'933.31	0.01	a)
US							94'933.31	0.01	
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden								1'293'538'842.58	91.85
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								1'293'538'842.58	91.85
CH1224004445	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE NT USD	0	192'609	192'609	0 USD	0.00	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.
CH1224004767	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE NT CHF	7'191'062	891'888	133'120	7'949'829	CHF	127.27	1'011'811'344.73	71.84 a)
CH1224025382	SWC (CH) IEF JAPAN RESPONSIBLE NT	898'840	105'875	30'510	974'205	JPY	14'442.01	81'983'824.62	5.82 1 a)
CH1224244819	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE NT CHF	1'422'264	165'337	44'613	1'542'988	CHF	129.45	199'743'673.23	4.18 a)
CH								1'293'538'842.58	91.85

Nicht kotierte Wertpapiere

0.00 0.00

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte

0.00 0.00

GB00B7FC0762	NMC HEALTH PLC	332	0	0	332	GBP	0.00	0.00	0.00 c)
--------------	----------------	-----	---	---	-----	-----	------	------	---------

AE

0.00 0.00

Derivative Finanzinstrumente

0.00 0.00

Optionen und Optionscheine

0.00 0.00

CA21037X1345	CONSTELLATION SOFTWARE --- WARRANT	486	0	0	486	CAD	0.00	0.00	0.00 a)
--------------	---------------------------------------	-----	---	---	-----	-----	------	------	---------

Futures

0.00 0.00

03/24	TOPIX INDX FUTR MAR24	2	0	2	0	JPY	0.00	0.00	0.00
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	11	2	13	0	EUR	0.00	0.00	0.00
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	16	1	17	0	USD	0.00	0.00	0.00
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	3	0	3	0	GBP	0.00	0.00	0.00
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	1	0	1	0	CAD	0.00	0.00	0.00
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	1	0	1	0	AUD	0.00	0.00	0.00
06/24	TOPIX INDX FUTR JUN24	0	16	16	0	JPY	0.00	0.00	0.00
06/24	SPI 200 FUTURES JUN24	0	6	6	0	AUD	0.00	0.00	0.00
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	84	84	0	EUR	0.00	0.00	0.00
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	118	118	0	USD	0.00	0.00	0.00
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	17	17	0	GBP	0.00	0.00	0.00
06/24	S&P/TSX 60 IX FUT JUN24	0	9	9	0	CAD	0.00	0.00	0.00
09/24	TOPIX INDX FUTR SEP24	0	20	14	6	JPY	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	SPI 200 FUTURES SEP24	0	14	9	5	AUD	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	EURO STOXX 50 SEP24	0	104	70	34	EUR	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	S&P500 EMINI FUT SEP24	0	158	108	50	USD	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	FTSE 100 IDX FUT SEP24	0	24	17	7	GBP	0.00	0.00	0.00 a)
09/24	S&P/TSX 60 IX FUT SEP24	0	7	4	3	CAD	0.00	0.00	0.00 a)

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

GBP/CHF	Verfall 03.04.2024	11'817'813	10'642'000			CHF/GBP	0.00	0.00
ILS/CHF	Verfall 03.04.2024	316'771	1'288'000			CHF/ILS	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.04.2024	223'492'299	254'650'000			CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024	27'478'591	28'897'000			CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 03.04.2024	19'619'036	3'330'041'000			CHF/JPY	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 03.04.2024	6'031'281	10'543'000			CHF/AUD	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 03.04.2024	2'525'631	29'735'000			CHF/SEK	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 03.04.2024	556'795	6'718'000			CHF/NOK	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall 03.04.2024	3'043'922	23'855'000			CHF/DKK	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 03.04.2024	1'055'608	1'615'000			CHF/SGD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024	9'534'510	14'727'000			CHF/CAD	0.00	0.00
HKD/CHF	Verfall 03.04.2024	1'580'366	14'084'000			CHF/HKD	0.00	0.00
NZD/CHF	Verfall 03.04.2024	178'078	333'000			CHF/NZD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024	41'249	43'000			CHF/EUR	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 03.04.2024	38'098	6'472'000			CHF/JPY	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 03.04.2024	43'113	45'000			CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024	48'329	43'000			CHF/GBP	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 03.04.2024	59'992	92'000			CHF/CAD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.04.2024	315'098	354'000			CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall 03.04.2024	400'000	359'315			USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 03.04.2024	125'634	140'000			CHF/USD	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall 03.04.2024	30'204	232'000			CHF/DKK	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 03.04.2024	27'070	4'560'000			CHF/JPY	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 03.04.2024	41'845	37'000			CHF/GBP	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.
CHF/JPY	Verfall 03.04.2024		21'707'000	129'333	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.04.2024		89'000	101'411	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024		225'000	219'889	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.04.2024		466'000	420'463	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 03.04.2024		333'000	179'414	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.04.2024		14'819'000	9'862'785	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 03.04.2024		1'615'000	1'077'770	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 03.04.2024		14'084'000	1'620'928	HKD/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 03.04.2024		1'288'000	316'629	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.04.2024		3'319'366'000	19'753'547	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.04.2024		10'543'000	6'195'594	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.04.2024		28'760'000	27'974'852	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.04.2024		254'278'000	229'015'481	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 03.04.2024		24'087'000	3'140'945	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 03.04.2024		6'718'000	557'796	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 03.04.2024		29'735'000	2'504'579	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.04.2024		10'633'000	12'097'589	GBP/CHF		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 03.05.2024		175'595	327'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.05.2024		9'918'360	14'946'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'122'227	1'685'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'494'088	13'013'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 03.05.2024		321'288	1'310'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.05.2024		6'163'662	10'515'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		28'359'663	29'218'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		229'932'415	256'157'000	CHF/USD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.05.2024		3'147'823	24'185'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 03.05.2024		550'624	6'649'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.05.2024		2'533'177	30'140'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024		12'278'048	10'826'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		184'007	189'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.05.2024		39'457	67'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.05.2024		51'913	78'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'849'010	2'047'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.05.2024		44'000	43'187	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.05.2024		87'000	78'497	USD/CHF		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		70'130	72'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024		94'185	83'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		144'817	161'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		180'918	199'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		71'793	74'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		85'760	94'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.05.2024		165'000	98'549	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.05.2024		358'000	326'012	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 03.05.2024		1'310'000	321'919	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 03.05.2024		1'685'000	1'133'247	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.05.2024		3'407'753'000	19'862'088	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.05.2024		10'909'000	12'527'241	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.05.2024		15'024'000	10'030'173	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 03.05.2024		30'140'000	2'518'800	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 03.05.2024		13'013'000	1'525'891	HKD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 03.05.2024		327'000	177'479	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 03.05.2024		24'185'000	3'180'086	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 03.05.2024		6'649'000	550'604	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.05.2024		258'213'000	236'832'964	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.05.2024		10'417'000	6'204'157	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.05.2024		29'509'000	28'940'952	EUR/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.05.2024		20'166'536	3'384'141'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.05.2024		264'665	44'210'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 07.05.2024		20'598'000	119'748	JPY/CHF		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 03.06.2024		299'096	1'220'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.06.2024		1'128'881	1'682'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 03.06.2024		18'845'226	3'230'003'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.06.2024		12'759'198	11'148'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.06.2024		9'866'677	14'824'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.06.2024		2'485'248	29'802'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 03.06.2024		1'596'297	13'648'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.06.2024		3'106'763	23'674'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 03.06.2024		557'373	6'749'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.06.2024		227'993'143	249'449'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.06.2024		5'956'459	10'027'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.06.2024		28'385'111	29'008'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.06.2024		1'467'000	1'335'988	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.06.2024		14'624'000	86'805	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.06.2024		94'000	91'597	EUR/CHF		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.
	CHF/GBP Verfall 03.06.2024		46'000	52'320	GBP/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.06.2024		451'027	500'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.06.2024		411'956	455'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.06.2024		65'052	66'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.06.2024		75'586	893'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.06.2024		541'000	494'133	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.06.2024		98'000	65'485	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.06.2024		810'000	68'985	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.06.2024		199'000	197'009	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.06.2024		36'967'000	216'073	JPY/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.06.2024		159'927	175'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.06.2024		169'269	313'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.06.2024		313'000	173'520	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.06.2024		1'220'000	295'862	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.06.2024		1'682'000	1'122'747	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		3'178'412'000	18'246'818	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		28'781'000	28'185'233	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.06.2024		29'885'000	2'563'446	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		23'674'000	3'108'420	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.06.2024		6'749'000	579'942	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		248'571'000	224'235'899	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		10'027'000	6'015'598	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		14'726'000	9'745'372	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.06.2024		13'648'000	1'574'037	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		11'102'000	12'751'091	GBP/CHF		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 01.07.2024		140'929	255'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 01.07.2024		288'668	1'193'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 01.07.2024		959'358	1'440'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.07.2024		18'843'769	3'279'179'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.07.2024		28'503'523	29'164'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 01.07.2024		2'624'901	30'659'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 01.07.2024		3'218'596	24'555'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 01.07.2024		519'482	6'061'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		231'389'595	257'328'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.07.2024		6'104'061	10'199'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.07.2024		12'882'935	11'251'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.07.2024		74'959	13'044'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 01.07.2024		67'556	787'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		1'554'868	1'739'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.07.2024		345'378	355'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 01.07.2024		136'000	154'821	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.07.2024		213'000	190'032	USD/CHF		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.07.2024		64'320	109'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		148'500	166'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.07.2024		68'826	12'030'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 01.07.2024		107'000	102'925	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.07.2024		80'000	71'624	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 01.07.2024		53'000	60'351	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 01.07.2024		23'386'000	133'766	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 01.07.2024		154'000	148'322	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.07.2024		1'722'000	1'545'402	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 01.07.2024		48'000	54'764	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.07.2024		85'000	75'576	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 01.07.2024		84'000	50'012	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.07.2024		1'332'000	1'186'868	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 01.07.2024		33'458'000	189'178	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 01.07.2024		184'520	163'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.07.2024		5'081'031	5'666'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 01.07.2024		55'872	435'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 01.07.2024		513'500	536'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 01.07.2024		501'965	89'861'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.07.2024		75'167	126'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.07.2024		9'887'026	14'981'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.07.2024		1'551'978	13'491'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.07.2024		36'743	56'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		100'000	65'178	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.07.2024		216'767	331'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.07.2024		24'990'000	3'227'209	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		29'794'000	28'696'866	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.07.2024		10'350'000	6'212'101	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.07.2024		15'268'000	10'027'106	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		261'467'000	234'972'810	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.07.2024		11'177'000	12'697'441	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.07.2024		31'446'000	2'668'728	SEK/CHF		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.
	CHF/NZD Verfall 02.07.2024		255'000	139'639		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.07.2024		1'193'000	284'608		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.07.2024		3'337'270'000	18'641'089		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.07.2024		1'440'000	954'835		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.07.2024		6'061'000	511'542		NOK/CHF	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.07.2024		15'044'003	15'044'003		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.07.2024		13'491'000	1'553'003		HKD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.08.2024		3'400'545	26'387'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2024		28'150'843	29'297'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.08.2024		6'385'463	10'672'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.08.2024		9'980'902	15'244'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		246'463'092	275'323'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.08.2024		12'709'465	11'229'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.08.2024		2'632'209	31'088'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.08.2024		159'825	293'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.08.2024		288'809	1'214'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.08.2024		19'249'775	3'442'790'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.08.2024		998'842	1'510'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.08.2024		515'267	6'124'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.08.2024		1'459'504	12'715'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2024		300'000	270'257		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.08.2024		6'362'000	35'611		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.08.2024		59'000	57'107		EUR/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		194'307	217'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.08.2024		679'000	87'771		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2024		161'000	142'168		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		481'868	543'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2024		153'733	159'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.08.2024		110'214	115'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.08.2024		76'697	939'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2024		87'386	99'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.08.2024		25'708'000	3'282'552		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.08.2024		3'436'428'000	20'103'722		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.08.2024		293'000	153'236		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.08.2024		11'229'000	12'699'572		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2024		275'721'000	242'778'406		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.08.2024		6'124'000	493'062		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.08.2024		1'214'000	284'137		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.08.2024		15'244'000	9'716'373		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.08.2024		32'027'000	2'630'666		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.08.2024		12'715'000	1'433'209		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.08.2024		10'672'000	6'136'251		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.08.2024		1'510'000	993'882		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.08.2024		29'512'000	28'116'319		EUR/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		3'079'153	24'165'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		19'990'091	3'413'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.09.2024		158'387	304'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		12'979'555	11'517'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		243'025'625	277'065'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		511'615	6'374'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.09.2024		304'162	1'302'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		10'222'194	16'085'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		2'702'973	32'983'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		1'425'629	12'685'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		6'296'202	10'983'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.09.2024		1'030'323	1'569'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		28'105'575	29'570'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		184'171	198'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		45'872	7'697'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		1'270'007	1'501'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		31'199	51'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		53'993	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		48'248	88'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		179'041	30'465'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		27'013	244'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		156'150	181'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		231'466	267'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.09.2024		139'635	214'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		1'106'293	1'765'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		2'129'178	363'261'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.09.2024		36'601	160'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		154'771	1'415'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		25'533'892	29'967'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		47'208	582'000		CHF/NOK	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.
	NZD/CHF Verfall 03.09.2024		10'478	20'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		336'198	2'645'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		3'025'932	3'190'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		291'257	3'492'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		669'108	1'165'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		1'335'714	1'200'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		104'873	94'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		152'627	26'184'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		77'771	136'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		77'021	123'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		896'449	1'053'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		108'729	857'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		88'058	15'071'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		1'213'607	1'441'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		270'922	288'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		99'201	89'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		848'510	1'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.09.2024		12'372'000	7'121'818		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.09.2024		1'462'000	341'933		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.09.2024		27'667'000	3'483'275		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.09.2024		3'856'578'000	22'471'509		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.09.2024		14'344'000	1'560'125		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.09.2024		12'950'000	14'439'768		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.09.2024		6'956'000	557'106		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.09.2024		36'475'000	3'021'589		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.09.2024		33'246'000	31'221'319		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.09.2024		18'024'000	11'346'108		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.09.2024		312'475'000	265'106'915		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.09.2024		1'783'000	1'160'537		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.09.2024		324'000	171'999		NZD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 01.10.2024		7'456'982	12'988'000		CHF/AUD	0.00	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 01.10.2024		3'638'397	28'949'000		CHF/DKK	0.00	0.00	b)
	ILS/CHF Verfall 01.10.2024		366'292	1'570'000		CHF/ILS	0.00	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 01.10.2024		22'648'540	3'883'974'000		CHF/JPY	0.00	0.00	b)
	GBP/CHF Verfall 01.10.2024		14'766'113	13'283'000		CHF/GBP	0.00	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 01.10.2024		579'079	7'250'000		CHF/NOK	0.00	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 01.10.2024		3'200'858	38'711'000		CHF/SEK	0.00	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 01.10.2024		32'905'713	35'111'000		CHF/EUR	0.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 01.10.2024		11'950'536	19'030'000		CHF/CAD	0.00	0.00	b)
	USD/CHF Verfall 01.10.2024		279'290'212	330'288'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 01.10.2024		1'174'194	1'807'000		CHF/SGD	0.00	0.00	b)
	NZD/CHF Verfall 01.10.2024		166'682	315'000		CHF/NZD	0.00	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 02.10.2024		1'706'913	15'728'000		CHF/HKD	0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							0.00	0.00	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	22'518'500.88	1.60
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	85'447'462.26	6.07
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'293'538'842.58	91.85
Sonstige Vermögenswerte	6'829'898.98	0.48
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'408'334'704.70	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-196'814.79	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'408'137'889.91	

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);	1'378'986'304.84	97.92
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.57567333
CAD	1 = CHF	0.62953070
DKK	100 = CHF	12.59089400
EUR	1 = CHF	0.93915344
GBP	1 = CHF	1.11507541
HKD	100 = CHF	10.87700600
ILS	1 = CHF	0.23389387
JPY	100 = CHF	0.58270700
NOK	100 = CHF	8.01014000
NZD	1 = CHF	0.53083274
SEK	100 = CHF	8.28503800
SGD	1 = CHF	0.65092639
USD	1 = CHF	0.84845000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	17'630'276.57	1.252
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	380'962'298.80	27.054

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	
FA CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.041	0.00 - 0.04	-	0.009
GT USD	CHF	0.00 - 0.08	-	0.041	0.00 - 0.04	-	0.009
NA CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.041	0.00 - 0.04	-	0.009
NT CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.041	0.00 - 0.04	-	0.009
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.041	0.00 - 0.04	-	0.009

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
FA CHF	0.250	0.500	0.150	0.100	3.000
GT USD	0.220	0.350	0.170	0.050	3.000
NA CHF	-	-	-	-	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
NTH1 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

MSCI World ex Switzerland Index TR Net

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 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.