

SWISSCANTO (CH) INDEX EQUITY FUND EUROPE (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
GT CHF	122424489	CHF
NT CHF	122424481	CHF
ST CHF	122424485	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	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Pauschale Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Fussnoten	16
11	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident
Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Vizepräsident
Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
Zürcher Kantonalbank

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer
Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services
Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.03.2024	01.03.2022
	bis	31.08.2024	29.02.2024
Konsolidiert			
	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'376'844'467.86	1'126'163'631.69
Klasse GT CHF			
	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		36'749'908.12	2'972'669.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		284'497.323	24'299.598
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		129.1749	122.3341
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		137.5440	128.3831
Thesaurierung je Anteil		-	3.48
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %
Klasse NT CHF			
	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		311'613'126.65	193'974'716.30
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'407'162.541	1'582'464.884
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		129.4525	122.5776
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		137.8395	128.6386
Thesaurierung je Anteil		-	3.71
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %
Klasse ST CHF			
	CHF		
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'028'481'433.09	929'216'246.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'944.862	7'580.642
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		129'452.3974	122'577.5134
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		137'839.4542	128'638.5263
Thesaurierung je Anteil		-	3'711.14
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 GT CHF (Lancierung 31.10.2022)	6.60 %	10.46 %	3.79 %	-
Klasse NT CHF (Lancierung 31.10.2022)	6.68 %	10.62 %	3.82 %	-
Klasse ST CHF (Lancierung 31.10.2022)	6.68 %	10.62 %	3.82 %	-
Benchmark	6.06 %	9.77 %	3.72 %	-
Tracking Error 33)	-	0.71 %	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 GT CHF (Lancierung 31.10.2022)	0.54 %
Klasse NT CHF (Lancierung 31.10.2022)	0.62 %
Klasse ST CHF (Lancierung 31.10.2022)	0.62 %

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	10'324'909.46	8'901'762.28
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'365'038'083.74	1'115'793'944.74
Sonstige Vermögenswerte	3'274'651.01	1'468'240.72
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'378'637'644.21	1'126'163'947.74
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'788'826.75	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-4'349.60	-316.05
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'376'844'467.86	1'126'163'631.69

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse GT CHF	von bis	Lancierung	
		01.03.2024 31.08.2024	31.10.2022 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		24'299.598	-
Ausgegebene Anteile		277'546.590	116'203.277
Zurückgenommene Anteile		-17'348.865	-91'903.679
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		284'497.323	24'299.598

Klasse NT CHF	von bis	Lancierung	
		01.03.2024 31.08.2024	31.10.2022 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'582'464.884	-
Ausgegebene Anteile		479'050.498	804'846.962
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		507'823.529	928'329.717
Zurückgenommene Anteile		-162'176.370	-150'711.795
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'407'162.541	1'582'464.884

Klasse ST CHF	von bis	Lancierung	
		01.03.2024 31.08.2024	31.10.2022 29.02.2024
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'580.642	-
Ausgegebene Anteile		704.079	1'773.825
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	5'900.824
Zurückgenommene Anteile		-339.859	-94.007
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'944.862	7'580.642

Sacheinlagen (Ausgabe von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse NT CHF	04.04.2024	40'199'150.26	305'340.536
Klasse NT CHF	04.04.2024	18'018'422.67	136'862.466
Klasse NT CHF	20.06.2024	2'675'325.95	20'543.779
Klasse NT CHF	20.06.2024	5'870'146.55	45'076.748

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2022 29.02.2024
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'126'163'631.69	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-13'348'974.16	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr		189'669'515.21	1'011'021'910.39
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		74'360'295.12	115'141'721.30
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'376'844'467.86	1'126'163'631.69

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.03.2024 31.08.2024	01.03.2022 29.02.2024
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		164'673.83	228'745.37
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		27'642'091.10	23'219'513.41
Erträge der Gratisaktien		223'517.38	882'985.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		2'545'557.35	10'857'259.89
Total Ertrag		30'575'839.66	35'188'503.90
Aufwand			
Passivzinsen		-206.16	-57.82
Reglementarische Vergütungen		-21'356.02	-13'320.11
Sonstige Aufwendungen		-2'999.14	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-677'613.89	-1'084'822.86
Total Aufwand		-702'175.21	-1'098'200.79
Nettoertrag / Verlust		29'873'664.45	34'090'303.11
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		7'391'316.03	-10'094'706.55
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		322'072.77	609'347.69
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		469'326.68	785'076.23
Realisierter Erfolg		38'056'379.93	25'390'020.48
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		36'303'915.19	89'751'700.82
Gesamterfolg		74'360'295.12	115'141'721.30

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							1'365'038'083.74	99.01	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							1'365'038'083.74	99.01	
BE0003565737	KBC GROUP NV	58'481	5'470	0	63'951 EUR	70.34	4'224'606.45	0.31	a)
BE0003604155	LOTUS BAKERIES	97	11	108	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974293251	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	185'829	20'824	0	206'653 EUR	55.30	10'732'561.83	0.78	a)
BE0974464977	SYENQO SA	25'335	12'701	0	38'036 EUR	74.40	2'657'690.03	0.19	a)
BE							17'614'858.31	1.28	
BMG0112X1056	AEGON LTD	351'094	97'523	0	448'617 USD	6.11	2'327'372.96	0.17	a)
BM							2'327'372.96	0.17	
CH198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	85'545	3'757	0	89'302 GBP	2'820.00	2'808'112.69	0.20	a)
CH1216478797	DSM-FIRMENICH AG	20'349	2'766	0	23'115 EUR	123.00	2'670'149.41	0.19	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	211'797	18'591	0	230'388 EUR	28.77	6'224'955.77	0.45	a)
CH							11'703'217.87	0.85	
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	432'588	249'452	75'281	606'759 EUR	14.75	8'403'997.40	0.61	a)
DE0005190003	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	53'944	6'480	0	60'424 EUR	83.82	4'756'567.69	0.35	a)
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	21'142	936	0	22'078 EUR	78.20	1'621'448.04	0.12	a)
DE0005200000	BEIERSDORF AG	23'996	1'201	0	25'197 EUR	130.75	3'094'048.29	0.22	a)
DE0005313704	CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	11'086	4'385	2'105	13'366 EUR	66.35	832'873.30	0.06	a)
DE0005439004	CONTINENTAL AG	7'494	12'857	0	20'351 EUR	61.08	1'167'404.43	0.08	a)
DE0005470306	CTS EVENTIM AG & CO KGAA	0	6'766	0	6'766 EUR	84.90	539'481.10	0.04	a)
DE0005552004	DHL GROUP	171'261	8'627	0	179'888 EUR	39.20	6'622'543.41	0.48	a)
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	87'345	50'941	0	138'286 EUR	33.37	4'333'821.05	0.31	a)
DE0005785802	FRESENIUS MEDICAL CARE AG	42'014	23'617	0	65'631 EUR	34.86	2'148'686.02	0.16	a)
DE0006047004	HEIDELBERG MATERIALS AG	0	1'437	353	1'084 EUR	95.66	97'385.93	0.01	a)
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	8'511	0	0	8'511 EUR	75.15	600'684.09	0.04	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	33'143	9'880	0	43'023 EUR	82.76	3'343'934.22	0.24	a)
DE0006062144	COVESTRO AG	0	32'337	0	32'337 EUR	55.40	1'682'465.03	0.12	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	29'500	13'420	0	42'920 EUR	175.85	7'088'243.68	0.51	a)
DE0006602006	GEA GROUP AG	35'918	14'855	0	50'773 EUR	42.40	2'021'786.23	0.15	a)
DE0007010803	RATIONAL AG	409	197	0	606 EUR	911.50	518'759.25	0.04	a)
DE0007100000	MERCEDES-BENZ GROUP AG	137'087	18'800	0	155'887 EUR	62.34	9'126'688.98	0.66	a)
DE0007164600	SAP SE	165'765	52'462	12'140	206'087 EUR	197.72	38'268'175.12	2.78	a)
DE0007165631	SARTORIUS AG-VORZUG	6'364	2'820	9'184	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	112'454	12'055	0	124'509 EUR	169.92	19'869'264.82	1.44	a)
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	12'241	6'934	19'175	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	69'896	18'585	0	88'481 EUR	280.90	23'342'013.46	1.69	a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28'838	3'416	195	32'059 EUR	489.30	14'732'001.04	1.07	a)
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES AG	16'043	3'961	0	20'004 EUR	270.00	5'072'442.86	0.37	a)
DE000A12DM80	SCOUT24 SE	21'827	1'345	0	23'172 EUR	69.10	1'503'758.59	0.11	a)
DE000A1DAH00	BRENNTAG SE	39'294	4'608	0	43'902 EUR	67.22	2'771'528.62	0.20	a)
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	26'825	7'386	0	34'211 EUR	232.00	7'454'015.77	0.54	a)
DE000A1ML7J1	VONOVIA SE	138'989	8'642	13'331	134'300 EUR	31.18	3'932'680.61	0.29	a)
DE000BASF111	BASF SE	173'303	72'105	0	245'408 EUR	45.85	10'567'313.94	0.77	a)
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	263'782	29'773	13'770	279'785 EUR	13.38	3'515'742.78	0.26	a)
DE000DTR0CK8	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	142'584	34'979	28'310	149'253 EUR	34.66	4'858'343.09	0.35	a)
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	164'876	35'808	4'437	196'247 EUR	26.05	4'801'172.48	0.35	a)
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	69'947	13'956	0	83'903 EUR	20.05	1'579'895.71	0.11	a)
DE000KBX1006	KNORR-BREMSE AG	6'296	9'316	0	15'612 EUR	74.35	1'090'124.42	0.08	a)
DE000LEG1110	LEG IMMOBILIEN SE	15'926	0	3'431	12'495 EUR	87.06	1'021'624.92	0.07	a)
DE000PAG9113	DR ING HC F PORSCHE AG	13'839	23'439	0	37'278 EUR	70.84	2'480'091.54	0.18	a)
DE000SHL1006	SIEMENS HEALTHINEERS AG	81'695	11'955	0	93'650 EUR	52.58	4'624'501.42	0.34	a)
DE000SYM9999	SYMRISE AG	34'978	9'119	0	44'097 EUR	119.05	4'930'318.75	0.36	a)
DE000TLX1005	TALANX AG	17'054	7'082	0	24'136 EUR	77.85	1'764'657.67	0.13	a)
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	42'667	28'631	0	71'298 EUR	23.44	1'569'536.82	0.11	a)
DE							217'750'022.57	15.79	

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.
DK0010181759	CARLSBERG A/S-B	16'147	1'205	0	17'352 DKK	792.00	1'730'339.37	0.13	a)
DK0010219153	ROCKWOOL A/S-B SHS	163	906	0	1'069 DKK	2'924.00	393'560.62	0.03	a)
DK0010244425	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	100	0	0	100 DKK	9'795.00	1'233'327.81	0.01	a)
DK0010244508	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	579	552	0	1'131 DKK	10'065.00	1'433'286.31	0.10	a)
DK0010272202	GENMAB A/S	12'035	2'622	14'657	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0010274414	DANSKE BANK A/S	130'724	61'318	0	192'042 DKK	210.60	5'092'266.86	0.37	a)
DK0060094928	ORSTED A/S	28'304	8'905	0	37'209 DKK	390.60	1'829'939.81	0.13	a)
DK0060336014	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	66'449	17'198	913	82'734 DKK	468.00	4'875'132.71	0.35	a)
DK0060448595	COLOPLAST-B	22'063	988	23'051	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060738599	DEMANT A/S	21'023	11'546	0	32'569 DKK	285.60	1'171'167.99	0.08	a)
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	182'911	58'107	0	241'018 DKK	154.90	4'700'645.11	0.34	a)
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	495'409	110'928	16'487	589'850 DKK	938.10	69'670'236.93	5.05	a)
DK0062616637	SVITZER A/S	0	1'544	1'544	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK							91'019'903.52	6.60	
ES0105046009	AENA SME SA	13'271	1'242	1'063	13'450 EUR	182.60	2'306'532.67	0.17	a)
ES0105066007	CELLNEX TELECOM SA	58'976	3'576	0	62'552 EUR	34.93	2'051'995.19	0.15	a)
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	82'088	43'805	1'813	124'080 EUR	60.94	7'101'347.88	0.52	a)
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	0	448'578	0	448'578 EUR	9.59	4'040'109.45	0.29	a)
ES0113860A34	BANCO DE SABADELL SA	0	301'049	0	301'049 EUR	1.94	549'346.73	0.04	a)
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	2'479'791	298'041	6'728	2'771'104 EUR	4.50	11'700'803.37	0.85	a)
ES0125220311	ACCIONA SA	9'849	3'078	0	12'927 EUR	122.30	1'484'775.39	0.11	a)
ES0127797019	EDP RENOVAVEIS SA	211'940	76'259	0	288'199 EUR	14.47	3'916'494.80	0.28	a)
ES0127797035	EDP RENOVAVEIS SA	0	4'428	4'428	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0130670112	ENDESA SA	31'790	5'445	0	37'235 EUR	19.10	667'915.13	0.05	a)
ES0130960018	ENAGAS SA	149'695	26'236	175'931	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0140609019	CAIXABANK SA	567'625	319'230	0	886'855 EUR	5.46	4'547'595.37	0.33	a)
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	1'012'995	74'710	0	1'087'705 EUR	12.82	13'095'910.66	0.95	a)
ES0144583301	IBERDROLA SA - ENT	0	31'077	31'077	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	167'464	70'113	0	237'577 EUR	48.98	10'928'479.16	0.79	a)
ES0167050261	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCC	0	2'025	2'025	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0167050915	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	67'673	4'428	24'675	47'426 EUR	41.12	1'831'496.77	0.13	a)
ES0171996087	GRIFOLS SA	62'813	60'758	123'571	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173093024	REDEIA CORP SA	29'155	5'819	0	34'974 EUR	17.18	564'293.46	0.04	a)
ES0178430E18	TELEFONICA SA	1'050'009	88'498	0	1'138'507 EUR	4.09	4'377'438.94	0.32	a)
ES							69'164'534.97	5.02	
FI0009000681	NOKIA OYJ	1'166'681	391'512	83'603	1'474'590 EUR	3.98	5'508'998.03	0.40	a)
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	76'859	0	11'115	65'744 EUR	20.02	1'236'108.95	0.09	a)
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	133'516	56'977	0	190'493 EUR	11.70	2'092'260.72	0.15	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	100'215	3'845	0	104'060 EUR	30.58	2'988'531.63	0.22	a)
FI0009007132	FORTUM OYJ	0	54'072	0	54'072 EUR	14.46	734'306.34	0.05	a)
FI0009007884	ELISA OYJ	19'098	11'167	0	30'265 EUR	45.22	1'285'309.71	0.09	a)
FI0009013403	KONE OYJ-B	39'706	51'161	4'401	86'466 EUR	48.80	3'962'796.26	0.29	a)
FI0009014377	ORION OYJ-CLASS B	48'650	2'697	51'347	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009014575	METSO CORP	148'331	8'446	20'508	136'269 EUR	9.18	1'174'833.45	0.09	a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	703'488	42'110	0	745'598 SEK	121.06	7'478'466.53	0.54	a)
FI4000552500	SAMPO OYJ-A SHS	0	30'716	0	30'716 EUR	40.41	1'165'708.77	0.08	a)
FI							27'627'320.39	2.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	243'990	104'909	0	348'899 EUR	14.16	4'638'164.55	0.34	a)
FR0000051807	TELEPERFORMANCE	9'933	8'225	4'496	13'662 EUR	98.86	1'268'444.42	0.09	a)
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	4'532	1'136	0	5'668 EUR	2'169.00	11'545'850.96	0.84	a)
FR0000064578	COVIVIO	100	2'919	0	3'019 EUR	50.40	142'899.33	0.01	a)
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	42'751	9'983	0	52'734 EUR	168.72	8'355'911.57	0.61	a)
FR0000120172	CARREFOUR SA	110'489	22'667	0	133'156 EUR	14.58	1'823'286.09	0.13	a)
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	397'720	42'876	2'125	438'471 EUR	62.19	25'609'316.37	1.86	a)
FR0000120321	L'OREAL	34'392	18'448	2'428	50'412 EUR	396.60	18'776'869.64	1.36	a)
FR0000120404	ACCOR SA	0	3'507	0	3'507 EUR	38.07	125'387.78	0.01	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	49'543	13'428	0	62'971 EUR	32.41	1'916'708.97	0.14	a)
FR0000120578	SANOFI	193'900	71'883	9'832	255'951 EUR	101.20	24'326'178.93	1.76	a)
FR0000120628	AXA SA	265'621	131'400	25'306	371'715 EUR	34.40	12'008'951.28	0.87	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.
FR0000120644	DANONE	90'335	6'249	0	96'584	EUR	62.80	5'696'411.90	0.41 a)
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	30'317	1'325	0	31'642	EUR	128.80	3'827'510.08	0.28 a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	41'620	1'943	0	43'563	EUR	674.30	27'587'191.74	2.00 a)
FR0000121121	EURAZEO SE	26'127	0	5'319	20'808	EUR	71.30	1'393'337.81	0.10 a)
FR0000121220	SODEXO SA	33'491	12'584	0	46'075	EUR	80.50	3'483'355.33	0.25 a)
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	0	48'417	0	48'417	EUR	214.20	9'739'886.51	0.71 a)
FR0000121964	KLEPIERRE	80'455	3'888	0	84'343	EUR	27.06	2'143'450.16	0.16 a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	89'646	11'222	0	100'868	EUR	229.70	21'759'602.55	1.58 a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	45'476	6'586	0	52'062	EUR	29.94	1'463'892.54	0.11 a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	87'999	6'273	3'875	90'397	EUR	79.08	6'713'627.36	0.49 a)
FR0000125338	CAPGEMINI SE	38'187	17'801	5'133	50'855	EUR	187.50	8'955'121.54	0.65 a)
FR0000125486	VINCI SA	83'068	11'347	0	94'415	EUR	108.15	9'589'679.11	0.70 a)
FR0000127771	VIVENDI SE	197'017	25'988	223'005	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000130395	REMY COINTREAU	2'166	0	2'166	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000130452	EIFFAGE	12'922	1'046	0	13'968	EUR	94.80	1'243'595.43	0.09 a)
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	62'502	6'948	0	69'450	EUR	99.42	6'484'590.60	0.47 a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	141'340	6'039	8'785	138'594	EUR	21.83	2'841'415.33	0.21 a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	173'479	7'791	0	181'270	EUR	62.58	10'653'640.73	0.77 a)
FR0000131906	RENAULT SA	49'419	2'600	52'019	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000133308	ORANGE	599'380	19'400	0	618'780	EUR	10.30	5'985'632.47	0.43 a)
FR0004125920	AMUNDI SA	5'408	4'354	0	9'762	EUR	68.00	623'425.08	0.05 a)
FR0006174348	BUREAU VERITAS SA	52'046	12'136	0	64'182	EUR	29.84	1'798'658.10	0.13 a)
FR0010040865	GECINA SA	7'139	7'490	0	14'629	EUR	99.50	1'367'018.13	0.10 a)
FR0010208488	ENGIE	285'843	13'744	0	299'587	EUR	15.93	4'482'035.51	0.33 a)
FR0010220475	ALSTOM	38'740	36'399	0	75'139	EUR	18.48	1'303'726.26	0.09 a)
FR0010307819	LEGRAND SA	61'626	22'337	3'204	80'759	EUR	101.20	7'675'523.38	0.56 a)
FR0010313833	ARKEMA	20'681	0	0	20'681	EUR	84.15	1'634'414.51	0.12 a)
FR0010340141	ADP	11'269	1'123	2'580	9'812	EUR	118.50	1'091'974.37	0.08 a)
FR0010451203	REXEL SA	0	4'992	0	4'992	EUR	22.84	107'079.72	0.01 a)
FR0010533075	GETLINK SE	123'851	13'907	31'870	105'888	EUR	16.32	1'622'446.47	0.12 a)
FR0010908533	EDENRED	55'802	11'178	5'082	61'898	EUR	38.21	2'221'213.01	0.16 a)
FR0011981968	WORLDDLINE SA	53'052	0	53'052	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0013280286	BIOMERIEUX	6'793	6'381	0	13'174	EUR	104.70	1'295'391.06	0.09 a)
FR0013326246	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	33'406	1'357	0	34'763	EUR	72.46	2'365'658.94	0.17 a)
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	33'912	0	0	33'912	EUR	36.88	1'174'575.32	0.09 a)
FR001400AJ45	MICHELIN (CGDE)	66'033	4'888	0	70'921	EUR	35.51	2'365'168.45	0.17 a)
FR							271'228'219.39	19.67	
GB0000456144	ANTOFAGASTA PLC	163'227	11'567	14'047	160'747	GBP	1'853.00	3'321'410.35	0.24 a)
GB0000536739	ASHTREAD GROUP PLC	73'503	35'075	13'044	95'534	GBP	5'398.00	5'750'360.62	0.42 a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	161'493	296'250	0	457'743	GBP	507.20	2'588'839.91	0.19 a)
GB0002374006	DIAGEO PLC	464'664	125'447	0	590'111	GBP	2'472.50	16'269'501.61	1.18 a)
GB0004052071	HALMA PLC	114'958	25'121	0	140'079	GBP	2'606.00	4'070'536.78	0.30 a)
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	373'015	173'032	0	546'047	GBP	779.40	4'745'638.64	0.34 a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	2'892'690	301'711	0	3'194'401	GBP	666.70	23'747'840.70	1.72 a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1'109'894	791'628	55'688	1'845'834	GBP	223.80	4'606'350.30	0.33 a)
GB0006731235	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	62'504	10'066	0	72'570	GBP	2'490.00	2'014'933.46	0.15 a)
GB0006776081	PEARSON PLC	202'170	7'698	0	209'868	GBP	1'056.00	2'471'236.90	0.18 a)
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	353'717	217'178	0	570'895	GBP	652.00	4'150'573.16	0.30 a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	193'690	12'529	0	206'219	GBP	4'770.00	10'968'602.41	0.80 a)
GB0007669376	ST JAMES'S PLACE PLC	143'342	17'226	160'568	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0007908733	SSE PLC	40'209	62'751	0	102'960	GBP	1'887.00	2'166'430.06	0.16 a)
GB0007980591	BP PLC	2'990'834	720'544	252'882	3'458'496	GBP	429.40	16'559'741.63	1.20 a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	8'666'556	2'754'759	0	11'421'315	GBP	58.50	7'450'342.10	0.54 a)
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	833'902	453'158	0	1'287'060	GBP	161.05	2'311'339.61	0.17 a)
GB0009223206	SMITH & NEPHEW PLC	197'832	90'561	288'393	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	254'600	53'621	10'371	297'850	GBP	13'274.00	44'086'300.49	3.20 a)
GB0030913577	BT GROUP PLC	1'082'517	257'163	0	1'339'680	GBP	139.00	2'076'443.47	0.15 a)
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	11'401	33'470	0	44'871	GBP	4'950.00	2'476'710.16	0.18 a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	78'927	38'459	117'386	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0033195214	KINGFISHER PLC	646'237	32'388	0	678'625	GBP	284.20	2'150'592.70	0.16 a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	427'059	100'157	527'216	0	GBP	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.
GB00B033F229	CENTRICA PLC	1'326'433	61'763	1'388'196	0	GBP	0.00	0.00	
GB00B0744B38	BUNZL PLC	72'215	38'444	0	110'659	GBP	3'540.00	4'368'116.79	0.32 a)
GB00B082RF11	RENTOKIL INITIAL PLC	409'642	65'332	0	474'974	GBP	483.00	2'558'121.73	0.19 a)
GB00B05WJX34	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	64'653	19'587	0	84'240	GBP	10'250.00	9'628'230.14	0.70 a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	457'917	84'649	5'496	537'070	GBP	4'906.00	29'380'736.39	2.13 a)
GB00B1FH8J72	SEVERN TRENT PLC	67'701	18'316	0	86'017	GBP	2'571.00	2'465'986.00	0.18 a)
GB00B1KJ408	WHITBREAD PLC	26'376	2'427	0	28'803	GBP	2'885.00	926'590.37	0.07 a)
GB00B1VZOM25	HARGREAVES LANSDOWN PLC	0	88'435	0	88'435	GBP	1'111.00	1'095'575.92	0.08 a)
GB00B1WY2338	SMITHS GROUP PLC	100'174	10'344	0	110'518	GBP	1'802.00	2'220'710.99	0.16 a)
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	210'546	70'756	17'659	263'643	GBP	2'209.00	6'494'058.54	0.47 a)
GB00B1YW4409	3I GROUP PLC	187'662	25'056	0	212'718	GBP	3'179.00	7'540'480.27	0.55 a)
GB00B2B0DG97	RELX PLC	347'688	115'594	0	463'282	GBP	3'539.00	18'282'274.62	1.33 a)
GB00B39J2M42	UNITED UTILITIES GROUP PLC	108'853	109'039	0	217'892	GBP	1'019.50	2'477'038.48	0.18 a)
GB00B52N1N88	SEGRO PLC	130'496	0	0	130'496	GBP	871.20	1'267'708.21	0.09 a)
GB00B63H8491	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1'340'246	178'357	0	1'518'603	GBP	496.40	8'405'823.46	0.61 a)
GB00BD6K4575	COMPASS GROUP PLC	316'121	56'027	0	372'148	GBP	2'399.00	9'955'204.28	0.72 a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	24'742	1'407	0	26'149	USD	80.49	1'785'760.72	0.13 a)
GB00BDR05C01	NATIONAL GRID PLC	515'976	317'075	0	833'051	GBP	998.60	9'276'142.05	0.67 a)
GB00BF8Q6K64	ABRDN PLC	430'328	165'827	596'155	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BH4HK539	VODAFONE GROUP PLC	5'539'129	949'572	0	6'488'701	GBP	74.42	5'384'577.92	0.39 a)
GB00BHJYC057	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	138	1'616	0	1'754	GBP	7'584.00	148'331.08	0.01 a)
GB00BJFLV09	CRODA INTERNATIONAL PLC	47'347	1'642	0	48'989	GBP	4'107.00	2'243'507.45	0.16 a)
GB00BKFB1C65	M&G PLC	695'555	55'659	0	751'214	GBP	214.40	1'795'943.60	0.13 a)
GB00BL6K5J42	ENDEAVOUR MINING PLC	60'238	0	60'238	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BL9YR756	WISE PLC - A	0	59'316	0	59'316	GBP	704.50	465'969.07	0.03 a)
GB00BLGZ9862	TESCO PLC	1'461'076	500'463	0	1'961'539	GBP	353.70	7'736'352.43	0.56 a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	1'222'571	51'698	47'471	1'226'798	GBP	345.20	4'722'240.32	0.34 a)
GB00BM8Q5M07	JD SPORTS FASHION PLC	0	251'587	0	251'587	GBP	137.95	387'002.83	0.03 a)
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	284'171	67'895	0	352'066	GBP	834.00	3'274'118.36	0.24 a)
GB00BMVWC6P49	MONDI PLC	88'007	56'494	0	144'501	GBP	1'472.00	2'371'826.41	0.17 a)
GB00BNGDN821	MELROSE INDUSTRIES PLC	141'704	174'779	0	316'483	GBP	481.90	1'700'636.72	0.12 a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	1'060'651	235'166	57'797	1'238'020	GBP	2'681.00	37'010'820.52	2.68 a)
GB00BP9LHF23	SCHRODERS PLC	22'864	72'442	0	95'306	GBP	342.40	363'880.04	0.03 a)
GB00BPQY8M80	AVIVA PLC	509'165	179'889	0	689'054	GBP	504.60	3'877'079.82	0.28 a)
GB00BVYVFW23	AUTO TRADER GROUP PLC	191'264	45'437	0	236'701	GBP	851.00	2'246'124.84	0.16 a)
GB00BWFQGN14	SPIRAX GROUP PLC	10'581	8'828	0	19'409	GBP	7'695.00	1'665'390.27	0.12 a)
GB00BYWOPQ60	LAND SECURITIES GROUP PLC	151'830	66'832	218'662	0	GBP	0.00	0.00	0.00
JE00B8KF9B49	WPP PLC	158'783	85'219	0	244'002	GBP	724.20	1'970'407.92	0.14 a)
GB							359'476'493.62	26.07	
IE0001827041	CRH PLC	102'422	5'574	107'996	0	GBP	0.00	0.00	0.00
IE0002424939	DCC PLC	14'550	1'381	0	15'931	GBP	5'355.00	951'276.46	0.07 a)
IE0004906560	KERRY GROUP PLC-A	8'252	24'760	0	33'012	EUR	90.80	2'815'102.67	0.20 a)
IE0004927939	KINGSPAN GROUP PLC	27'946	16'626	0	44'572	EUR	78.70	3'294'377.84	0.24 a)
IE00B1RR8406	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	0	35'473	35'473	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	283'152	43'022	326'174	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE00BWT6H894	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	33'868	1'339	35'207	0	GBP	0.00	0.00	0.00
IE							7'060'756.97	0.51	
IM00B5VQMV65	ENTAIN PLC	97'007	40'828	0	137'835	GBP	646.00	992'878.87	0.07 a)
IM							992'878.87	0.07	
IT0003128367	ENEL SPA	1'413'001	597'256	0	2'010'257	EUR	6.86	12'958'818.63	0.94 a)
IT0003153415	SNAM SPA	886'061	190'282	0	1'076'343	EUR	4.48	4'531'646.07	0.33 a)
IT0003242622	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	0	237'289	0	237'289	EUR	7.86	1'752'052.84	0.13 a)
IT0003492391	DIASORIN SPA	21'397	3'015	24'412	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	2'003'005	3'747'713	0	5'750'718	EUR	0.24	1'291'872.94	0.09 a)
IT0004056880	AMPLIFON SPA	54'911	8'256	63'167	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	121'860	3'958	10'858	114'960	EUR	63.40	6'844'986.04	0.50 a)
IT0005239360	UNICREDIT SPA	320'530	104'772	899	424'403	EUR	37.38	14'898'903.11	1.08 a)
IT0005366767	NEXI SPA	132'388	55'411	0	187'799	EUR	6.31	1'113'613.30	0.08 a)
NL0011585146	FERRARI NV	29'162	4'545	1'919	31'788	EUR	447.20	13'350'623.63	0.97 a)
NL0015435975	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	204'135	47'461	0	251'596	EUR	8.34	1'971'580.80	0.14 a)
IT							58'714'097.36	4.26	

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.
GB00B0LCW083	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	61'013	35'901	96'914	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
JO							0.00	0.00	
LU1598757687	ARCELORMITTAL	27'075	50'977	16'484	61'568 EUR	21.17	1'224'087.48	0.09	a)
LU							1'224'087.48	0.09	
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	17'153	0	0	17'153 EUR	68.05	1'096'237.79	0.08	a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	810'078	122'677	0	932'755 EUR	3.69	3'235'068.25	0.23	a)
NL0000009165	HEINEKEN NV	29'867	5'216	0	35'083 EUR	81.46	2'683'970.16	0.19	a)
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	129'483	133'715	0	263'198 EUR	27.21	6'725'857.79	0.49	a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	12'355	10'017	4'601	17'771 EUR	43.55	726'836.25	0.05	a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	44'556	8'129	1'331	51'354 EUR	154.15	7'434'544.40	0.54	a)
NL0006294274	EURONEXT NV	22'054	0	0	22'054 EUR	96.60	2'000'787.89	0.15	a)
NL0010273215	ASML HOLDING NV	62'622	10'035	1'318	71'339 EUR	812.00	54'402'593.01	3.95	a)
NL0010558797	OCI NV	258	5'555	0	5'813 EUR	28.61	156'190.54	0.01	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	28'672	34'180	0	62'852 EUR	44.29	2'614'335.59	0.19	a)
NL0010801007	IMCD NV	13'642	770	1'553	12'859 EUR	147.80	1'784'917.65	0.13	a)
NL0010832176	ARGENX SE	0	9'728	0	9'728 EUR	468.10	4'276'601.23	0.31	a)
NL0011540547	ABN AMRO BANK NV-CVA	67'912	16'440	0	84'352 EUR	15.49	1'227'109.61	0.09	a)
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	141'363	20'720	0	162'083 EUR	31.06	4'727'978.27	0.34	a)
NL0011821202	ING GROEP NV	468'642	37'352	0	505'994 EUR	16.39	7'790'527.26	0.57	a)
NL0011872643	ASR NEDERLAND NV	30'337	0	30'337	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012969182	ADYEN NV	2'939	405	0	3'344 EUR	1'329.00	4'173'763.18	0.30	a)
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	32'502	16'113	0	48'615 EUR	57.70	2'634'405.70	0.19	a)
NL0013654783	PROSUS NV	219'172	91'515	40'541	270'146 EUR	33.53	8'506'847.52	0.62	a)
NL0014332678	JDE PEET'S NV	35'399	5'070	0	40'469 EUR	20.72	787'496.76	0.06	a)
NL00150001Q9	STELLANTIS NV	472'452	75'971	59'594	488'829 EUR	15.14	6'949'635.34	0.50	a)
NL0015000IY2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	0	4'991	0	4'991 EUR	23.63	110'761.25	0.01	a)
NL0015001F58	FERROVIAL SE	99'822	11'979	9'326	102'475 EUR	37.74	3'632'088.12	0.26	a)
NL0015001WM6	QIAGEN N.V.	62'605	32'198	94'803	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL							127'678'553.56	9.26	
NO0003054108	MOWI ASA	98'488	13'926	0	112'414 NOK	184.70	1'663'134.62	0.12	a)
NO0003733800	ORKLA ASA	149'324	19'902	0	169'226 NOK	94.20	1'276'903.56	0.09	a)
NO0005052605	NORSK HYDRO ASA	641'712	23'336	0	665'048 NOK	59.40	3'164'313.79	0.23	a)
NO0010063308	TELENOR ASA	102'710	41'706	0	144'416 NOK	131.50	1'521'181.98	0.11	a)
NO0010161896	DNB BANK ASA	248'412	31'080	0	279'492 NOK	224.10	5'017'083.68	0.36	a)
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	11'417	14'909	0	26'326 NOK	308.80	651'181.83	0.05	a)
NO0010310956	SALMAR ASA	24'845	0	0	24'845 NOK	551.00	1'096'555.72	0.08	a)
NO0010844038	ADEVINTA ASA-B	88'689	0	88'689	0 NOK	0.00	0.00	0.00	
NO							14'390'355.18	1.04	
LU2290522684	INPOST SA	0	8'310	0	8'310 EUR	16.66	130'020.72	0.01	a)
PL							130'020.72	0.01	
PTEDP0AM0009	EDP SA	408'568	169'700	0	578'268 EUR	3.80	2'061'540.72	0.15	a)
PT							2'061'540.72	0.15	
SE0000108227	SKF AB-B SHARES	40'239	0	0	40'239 SEK	194.25	647'593.84	0.05	a)
SE0000108656	ERICSSON LM-B SHS	604'908	326'292	90'047	841'153 SEK	76.52	5'332'666.99	0.39	a)
SE0000113250	SKANSKA AB-B SHS	71'733	0	0	71'733 SEK	207.30	1'232'005.94	0.09	a)
SE0000114837	TRELLEBORG AB-B SHS	0	3'914	0	3'914 SEK	400.20	129'775.41	0.01	a)
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	34'821	0	0	34'821 SEK	276.20	796'818.52	0.06	a)
SE0000115446	VOLVO AB-B SHS	270'365	14'439	0	284'804 SEK	272.60	6'432'302.21	0.47	a)
SE0000163594	SECURITAS AB-B SHS	0	77'663	0	77'663 SEK	120.00	772'129.09	0.06	a)
SE0000202624	GETINGE AB-B SHS	66'761	8'118	0	74'879 SEK	213.60	1'325'121.77	0.10	a)
SE0000242455	SWEDBANK AB - A SHARES	195'457	66'895	0	262'352 SEK	219.40	4'768'870.26	0.35	a)
SE0000667891	SANDVIK AB	151'592	57'833	0	209'425 SEK	218.30	3'787'710.38	0.27	a)
SE0000667925	TELIA CO AB	596'922	371'829	0	968'751 SEK	31.84	2'555'522.61	0.19	a)
SE0000695876	ALFA LAVAL AB	46'551	18'876	0	65'427 SEK	459.90	2'492'957.77	0.18	a)
SE0000872095	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	51'201	25'776	0	76'977 SEK	320.00	2'040'823.58	0.15	a)
SE0001515552	INDUTRADE AB	45'473	12'066	0	57'539 SEK	322.80	1'538'828.92	0.11	a)
SE0001662230	HUSQVARNA AB-B SHS	309	35'804	0	36'113 SEK	69.12	206'805.37	0.02	a)
SE0005190238	TELE2 AB-B SHS	124'157	51'485	0	175'642 SEK	116.50	1'695'308.75	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.
SE0007100581	ASSA ABLOY AB-B	215'472	66'287	0	281'759 SEK	331.10	7'729'145.50	0.56	a)
SE0007100599	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	300'886	176'597	0	477'483 SEK	105.90	4'189'366.72	0.30	a)
SE0010100958	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	53'845	0	2'812	51'033 SEK	308.60	1'304'792.72	0.09	a)
SE0012853455	EQT AB	76'503	6'463	28'206	54'760 SEK	342.80	1'555'244.80	0.11	a)
SE0015658109	EPIROC AB-A	97'882	5'234	0	103'116 SEK	197.80	1'689'844.92	0.12	a)
SE0015658117	EPIROC AB-B	21'680	32'000	0	53'680 SEK	182.30	810'762.55	0.06	a)
SE0015811963	INVESTOR AB-B SHS	419'937	17'049	46'815	390'171 SEK	305.35	9'870'687.80	0.72	a)
SE0015949201	LIFCO AB-B SHS	47'973	18'834	0	66'807 SEK	343.00	1'898'499.97	0.14	a)
SE0015949748	BEUER REF AB	109'932	6'579	0	116'511 SEK	176.70	1'705'681.68	0.12	a)
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	299'282	147'700	0	446'982 SEK	50.64	1'875'332.31	0.14	a)
SE0016844831	VOLVO CAR AB-B	75'850	0	75'850	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE0017486889	ATLAS COPCO AB-A SHS	370'951	83'772	0	454'723 SEK	186.15	7'013'010.14	0.51	a)
SE0017486897	ATLAS COPCO AB-B SHS	234'658	7'939	0	242'597 SEK	163.20	3'280'198.19	0.24	a)
SE0017832488	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	0	23'433	0	23'433 SEK	80.50	156'285.35	0.01	a)
SE0021628898	VOLVO CAR AB-B	0	243'844	0	243'844 SEK	29.38	593'551.45	0.04	a)
SE0021628914	VOLVO CAR AB -RED SHS	0	75'850	75'850	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
SE							79'427'645.51	5.76	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	49'673	18'819	2'602	65'890 USD	97.42	5'446'203.77	0.40	a)
US							5'446'203.77	0.40	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
DE000A3EX3N6	VONOVIA SE-SCRIP	0	134'300	134'300	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000LEG1268	LEG IMMOBILIEN SE-SCRIP	0	12'495	12'495	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0627797915	EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	0	279'001	279'001	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0644580957	IBERDROLA SA-RTS	0	1'056'628	1'056'628	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06670509P5	ACS ACTIVIDADES DE CO-RIGHTS	0	50'635	50'635	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400P9F6	COVIVIO SA/FRANCE	0	2'781	2'781	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400Q9B4	ALSTOM SA-RTS	0	45'491	45'491	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR001400RCT9	REMY COINTREAU SA-RTS	0	2'166	0	2'166 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
GB00BR1W9C86	SHELL PLC - EEE MAR24	1'071'187	0	1'071'187	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1W9Z14	SHELL PLC - EEE JUN24	0	1'125'329	1'125'329	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BR1WB003	SHELL PLC - EEE SEPT24	0	1'238'020	0	1'238'020 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
GB00BSRK4X90	NATIONAL GRID PLC-FULL	0	1'881	1'881	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BSRK4Y08	NATIONAL GRID PLC-NIL	0	1'881	1'881	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001YZ4	ABN AMRO BANK NV	0	84'352	84'352	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001Z20	WOLTERS KLUWER NV-DRIP	0	52'685	52'685	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0015001ZB2	NN GROUP NV-SCRIP	0	59'890	59'890	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150023G4	ARCELORMITTAL SA	0	68'350	68'350	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150023I0	FERROVIAL SE - SCRIP	0	110'879	110'879	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150024P3	AEGON LTD-DRIP	0	448'617	448'617	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL00150026X2	WOLTERS KLUWER NV -DRIP	0	51'354	0	51'354 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
NL00150027H3	ABN AMRO BANK NV	0	84'352	0	84'352 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
Diverse							0.00	0.00	
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							0.00	0.00	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							0.00	0.00	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	0	350'042	350'042	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH							0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente							0.00	0.00	
Futures							0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	91	11	102	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	22	3	25	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	683	683	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	151	151	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/24	EURO STOXX 50 SEP24	0	709	523	186 EUR	0.00	0.00	0.00	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2024	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.08.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
09/24	FTSE 100 IDX FUT SEP24	0	163	121	42 GBP	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

CHF/SEK	Verfall	07.05.2024	13'000'000	1'088'165	SEK/CHF	0.00	0.00
DKK/EUR	Verfall	07.05.2024	402'264	3'000'000	EUR/DKK	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	07.05.2024	3'800'000	3'710'058	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	08.05.2024	1'250'000	1'217'726	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/EUR	Verfall	27.08.2024	250'000	236'808	EUR/CHF	0.00	0.00
CHF/SEK	Verfall	27.08.2024	5'415'000	450'674	SEK/CHF	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte

0.00 0.00

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	10'324'909.46	0.75
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	1'365'038'083.74	99.01
Sonstige Vermögenswerte	3'274'651.01	0.24
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'378'637'644.21	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1'788'826.75	
Andere Verbindlichkeiten	-4'349.60	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	1'376'844'467.86	

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);	1'365'038'083.74	99.01
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

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

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	12'583'766.53	0.914
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-

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 Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
GT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.193	0.00 - 0.04	-	0.012
NT CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.193	0.00 - 0.04	-	0.012
ST CHF	CHF	0.00 - 0.27	-	0.193	0.00 - 0.04	-	0.012

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: 01.11.2022 - 29.02.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
GT CHF	0.150	0.350	0.100	0.050	3.000
NT CHF	-	-	-	-	3.000
ST 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 Europe ex Switzerland In-dex 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: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)

11 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

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