

## Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)

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

**Halbjahresbericht per 31. August 2021**

---

<b>Inhaltsverzeichnis</b>	<b>Seite</b>
Organisation und Verwaltung .....	2
Vertriebsorganisation .....	2
Abschlusszahlen .....	3
Collateral ausgeliehene Effekten .....	13
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I .....	13
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung .....	13
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte .....	13
Pauschale Verwaltungskommission .....	14
Benchmark .....	14
TER .....	14
Erklärung der Fussnoten .....	14
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte .....	15

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

**Swisscanto Fondsleitung AG**

Zürich, 14.10.2021

## Organisation und Verwaltung

---

### Fondsleitung

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Verwaltungsrat

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

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

Regina Kleeb, Mitglied  
Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement  
Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank

### Geschäftsführung

Hans Frey  
Geschäftsführer

Andreas Hogg  
stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer  
Leiterin Administration & Operations

### Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Fondsadministration

Firma: Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz: Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## Vertriebsorganisation

---

**Zahlstelle** Zürich Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

**Vertriebsträger** Zürich Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

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

Übersicht	von	01.03.2021	01.03.2020	01.03.2019	01.03.2018
	bis	31.08.2021	28.02.2021	29.02.2020	28.02.2019
<b>Konsolidiert</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'586'558'606.93	3'692'224'826.83	3'448'158'720.41	3'838'609'945.64
<b>Klasse DT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		31'786'754.97	95'521'799.21	66'252'126.07	65'224'163.27
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		126'944.106	459'544.740	348'756.902	369'517.375
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		250.3996	207.8618	189.9665	176.5118
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		231.5605	189.1627	178.6660	155.6022
Thesaurierung je Anteil		-	4.93	4.39	4.05
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.16 %	0.16 %
<b>Klasse FA CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		36'307'686.70	28'657'060.69	22'537'074.66	19'685'237.21
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		215'875.884	202'238.076	171'582.637	159'078.564
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		168.1878	141.6996	131.3482	123.7454
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		155.5340	128.9525	123.5348	109.0865
Ausschüttung je Anteil		-	3.60	3.00	2.80
Total Expense Ratio (TER)		0.15 %	0.15 %	0.17 %	0.19 %
<b>Klasse GT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'118'392'458.84	680'827'792.44	855'725'365.98	1'222'052'306.69
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'426'046.807	4'712'547.308	6'481'428.629	9'962'607.184
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		174.0405	144.4713	132.0273	122.6639
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		160.9464	131.4748	124.1734	108.1331
Thesaurierung je Anteil		-	3.44	3.07	2.84
Total Expense Ratio (TER)		0.14 %	0.14 %	0.14 %	0.14 %
<b>Klasse MT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		24'847'863.99	10'291'931.13	9'113.82	
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		204'868.962	102'262.252	100.000	
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		121.2866	100.6425	91.1382	
Thesaurierung je Anteil		-	2.51	0.00	
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	
<b>Klasse NT CHF</b>		<b>CHF</b>			
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'375'223'842.43	2'876'926'243.36	2'503'635'039.88	2'531'648'238.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'271'607.380	13'631'924.710	12'993'358.122	14'155'393.302
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		254.3191	211.0433	192.6858	178.8469
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in EUR		235.1852	192.0580	181.2235	157.6607
Thesaurierung je Anteil		-	5.30	4.75	4.37
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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

Halbjahresbericht per 31.08.2021  
 Swisscanto (CH) Index Equity Fund Switzerland Total (I)  
 Valorenummer Klasse DT CHF: 11 704 371 Valorenummer Klasse MT CHF: 51 788 856  
 Valorenummer Klasse FA CHF: 31 562 299 Valorenummer Klasse NT CHF: 11 704 370  
 Valorenummer Klasse GT CHF: 33 096 859 Rechnungswährung: CHF

<b>Performance</b>	<b>YTD / 31.08.2021</b>	<b>2020</b>	<b>2019</b>	<b>2018</b>
Klasse DT CHF	19.53 %	3.70 %	30.48 %	-8.68 %
Klasse FA CHF	19.53 %	3.69 %	30.43 %	-8.72 %
Klasse GT CHF	19.54 %	3.71 %	30.50 %	-8.66 %
Klasse MT CHF (Lancierung 28.01.2020)	19.65 %	2.13 %	-	-
Klasse NT CHF	19.65 %	3.86 %	30.68 %	-8.54 %
Benchmark	19.66 %	3.82 %	30.59 %	-8.57 %
Tracking Error *	-	0.06 %	0.82 %	0.87 %

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 Error: 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)

### Vermögensrechnung

#### (Verkehrswerte)

	<b>31.08.2021</b>	<b>28.02.2021</b>
Bankguthaben auf Sicht	50'400'676.05	2'372.99
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	4'504'617'876.80	3'682'660'240.72
Sonstige Vermögenswerte	31'685'596.44	10'738'930.43
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'704'149.29</b>	<b>3'693'401'544.14</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-1'079'764.54
Andere Verbindlichkeiten	-145'542.36	-96'952.77
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'558'606.93</b>	<b>3'692'224'826.83</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse DT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	31.08.2021	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			459'544.740	348'756.902
Ausgegebene Anteile			14'582.190	328'264.607
Zurückgenommene Anteile			-347'182.824	-217'476.769
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>126'944.106</b>	<b>459'544.740</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse FA CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	31.08.2021	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			202'238.076	171'582.637
Ausgegebene Anteile			24'702.126	71'048.519
Zurückgenommene Anteile			-11'064.318	-40'393.080
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>215'875.884</b>	<b>202'238.076</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse GT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	31.08.2021	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			4'712'547.308	6'481'428.629
Ausgegebene Anteile			2'650'894.642	3'827'028.099
Zurückgenommene Anteile			-937'395.143	-5'595'909.420
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>6'426'046.807</b>	<b>4'712'547.308</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse MT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	31.08.2021	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			102'262.252	100.000
Ausgegebene Anteile			102'606.710	29'590.000
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)			-	72'772.252
Zurückgenommene Anteile			-	-200.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>204'868.962</b>	<b>102'262.252</b>

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse NT CHF	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	31.08.2021	28.02.2021
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			13'631'924.710	12'993'358.122
Ausgegebene Anteile			557'452.479	2'548'620.658
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)			-	283'658.701
Zurückgenommene Anteile			-917'769.809	-2'086'777.735
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)			-	-106'935.036
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>13'271'607.380</b>	<b>13'631'924.710</b>

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	von	01.03.2021	01.03.2020
		bis	31.08.2021	28.02.2021
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			3'692'224'826.83	3'448'158'720.41
Ausbezahlte Ausschüttung			-760'293.12	-548'759.43
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-30'361'205.15	-31'442'774.12
Saldo aus dem Anteilverkehr			142'420'372.72	-119'069'553.86
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			783'034'905.65	395'127'193.83
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>			<b>4'586'558'606.93</b>	<b>3'692'224'826.83</b>

<b>Erfolgsrechnung</b>	<b>(konsolidiert)</b>	<b>von</b>	<b>01.03.2021</b>	<b>01.03.2020</b>
		<b>bis</b>	<b>31.08.2021</b>	<b>28.02.2021</b>
<b>Ertrag</b>				
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht			-50'317.52	-118'592.35
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte			90'638'462.50	105'798'797.90
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte			972.50	0.00
Erträge der Gratisaktien			0.00	9'337.08
Erträge aus Wertpapierleihe			95'452.25	322'559.65
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen			11'790'452.05	16'328'176.08
<b>Total Ertrag</b>			<b>102'475'021.78</b>	<b>122'340'278.36</b>
<b>Aufwand</b>				
Passivzinsen			7'194.68	-7'194.68
Reglementarische Vergütungen			-637'645.68	-1'521'612.09
Sonstige Aufwendungen			0.00	-2'998.53
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen			-7'863'485.30	-28'991'403.24
<b>Total Aufwand</b>			<b>-8'493'936.30</b>	<b>-30'523'208.54</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>			<b>93'981'085.48</b>	<b>91'817'069.82</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste			87'988'495.21	140'969'974.71
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip			7'493'476.03	12'292'144.79
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen			167'037.96	374'428.41
<b>Realisierter Erfolg</b>			<b>189'630'094.68</b>	<b>245'453'617.73</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste			593'404'810.97	149'673'576.10
<b>Gesamterfolg</b>			<b>783'034'905.65</b>	<b>395'127'193.83</b>

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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.08.2021	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>								<b>4'504'617'876.80</b>	<b>98.21</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>								<b>4'504'617'876.80</b>	<b>98.21</b>	
AT0000A18XM4	AMS AG	671'807	66'987	53'319	685'475	CHF	18.63	12'770'399.25	0.28	a)
AT0000KTM102	PIERER MOBILITY AG	20'060	883	0	20'943	CHF	82.00	1'717'326.00	0.04	a)
<b>AT</b>								<b>14'487'725.25</b>	<b>0.32</b>	
CH0000816824	OC OERLIKON CORP AG-REG	493'683	34'770	37'409	491'044	CHF	10.22	5'018'469.68	0.11	a)
CH0001307757	BANK LINTH LLB AG-REG	33	0	0	33	CHF	530.00	17'490.00	0.00	a)
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	226	0	0	226	CHF	5'300.00	1'197'800.00	0.03	a)
CH0001340204	GRAUBUENDNER KANTONALBANK-PC	1'861	0	0	1'861	CHF	1'525.00	2'838'025.00	0.06	a)
CH0001341608	HYPOTHEKARBANK LENZBURG-REG	70	0	0	70	CHF	4'260.00	298'200.00	0.01	a)
CH0001473559	BASELLANDS KANTONALBANK-CERT	1'987	0	0	1'987	CHF	922.00	1'832'014.00	0.04	a)
CH0001503199	BELIMO HOLDING AG-REG	1'219	0	1'219	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0001624714	CPH CHEMIE & PAPIER HLDG-REG	1'932	0	0	1'932	CHF	66.40	128'284.80	0.00	a)
CH0001752309	FISCHER (GEORG)-REG	10'023	1'066	888	10'201	CHF	1'503.00	15'332'103.00	0.33	a)
CH0002088976	VALORA HOLDING AG-REG	9'109	1'048	0	10'157	CHF	187.80	1'907'484.60	0.04	a)
CH0002178181	STADLER RAIL AG	142'916	15'335	12'714	145'537	CHF	39.68	5'774'908.16	0.13	a)
CH0002187810	PHOENIX MECANO AG-BR	1'926	0	0	1'926	CHF	474.50	913'887.00	0.02	a)
CH0002277314	SCHLATTER INDUSTRIES AG	374	0	0	374	CHF	26.80	10'023.20	0.00	a)
CH0002361068	STARRAG GROUP HOLDING AG	1'104	0	0	1'104	CHF	48.00	52'992.00	0.00	a)
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	15'612	2'314	872	17'054	CHF	463.00	7'896'002.00	0.17	a)
CH0002497458	SGS SA-REG	14'959	2'024	1'500	15'483	CHF	2'878.00	44'560'074.00	0.97	a)
CH0002619481	WARTECK INVEST AG-REG	524	0	0	524	CHF	2'430.00	1'273'320.00	0.03	a)
CH0003245351	VON ROLL HOLDING AG-BR	135'937	0	0	135'937	CHF	1.00	135'937.00	0.00	a)
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	2'982	0	0	2'982	CHF	7.28	21'708.96	0.00	a)
CH0003420806	ORELL FUESSLI HOLDING AG-REG	1'305	0	0	1'305	CHF	93.00	121'365.00	0.00	a)
CH0003541510	FORBO HOLDING AG-REG	2'936	344	547	2'733	CHF	1'962.00	5'362'146.00	0.12	a)
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	8'274	824	2'015	7'083	CHF	220.00	1'558'260.00	0.03	a)
CH0005319162	ELMA ELECTRONIC AG-REG	19	0	0	19	CHF	660.00	12'540.00	0.00	a)
CH0005795668	SWISS STEEL HOLDING AG	1'078'648	1'660'908	913'145	1'826'411	CHF	0.43	785'356.73	0.02	a)
CH0006089921	PRIVATE EQUITY HLDG-REG	10'070	0	0	10'070	CHF	82.50	830'775.00	0.02	a)
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	1'703	168	115	1'756	CHF	4'070.00	7'146'920.00	0.16	a)
CH0008012236	GURIT HOLDING AG-BR	795	106	0	901	CHF	1'892.00	1'704'692.00	0.04	a)
CH0008038389	SWISS PRIME SITE-REG	188'216	20'203	19'163	189'256	CHF	97.95	18'537'625.20	0.40	a)
CH0008207356	BVZ HOLDING AG-REG NEW	162	0	0	162	CHF	770.00	124'740.00	0.00	a)
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	4'183	0	0	4'183	CHF	61.00	255'163.00	0.01	a)
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	62'101	7'661	5'353	64'409	CHF	537.40	34'613'396.60	0.75	a)
CH0008837566	ALLREAL HOLDING AG-REG	35'437	6'106	4'729	36'814	CHF	192.80	7'097'739.20	0.15	a)
CH0008967926	ADVAL TECH HOLDING AG-REG	33	0	0	33	CHF	183.00	6'039.00	0.00	a)
CH0009002962	BARRY CALLEBAUT AG-REG	7'400	2'002	368	9'034	CHF	2'334.00	21'085'356.00	0.46	a)
CH0009062099	SCHAFFNER HOLDING AG-REG	1'003	0	0	1'003	CHF	291.00	291'873.00	0.01	a)
CH0009236461	BASLER KANTONALBK - PC	18'980	400	500	18'880	CHF	63.00	1'189'440.00	0.03	a)
CH0009320091	FEINTOOL INTL HOLDING-REG	7'536	0	1'300	6'236	CHF	66.40	414'070.40	0.01	a)
CH0009691608	BERNER KANTONALBANK AG-REG	11'984	632	870	11'746	CHF	204.50	2'402'057.00	0.05	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	271	32	29	274	CHF	111'900.00	30'660'600.00	0.67	a)
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	2'525	259	121	2'663	CHF	10'770.00	28'680'510.00	0.63	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	19'598	2'228	1'731	20'095	CHF	4'595.00	92'336'525.00	2.01	a)
CH0010675863	SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG	25'770	2'543	544	27'769	CHF	172.80	4'798'483.20	0.10	a)
CH0010702154	KOMAX HOLDING AG-REG	9'827	1'230	812	10'245	CHF	259.00	2'653'455.00	0.06	a)
CH0010754924	SCHWEITER TECHNOLOGIES AG-BR	2'477	200	51	2'626	CHF	1'406.00	3'692'156.00	0.08	a)
CH0011003594	GAVAZZI CARLO HOLDING AG-BR	409	146	0	555	CHF	256.00	142'080.00	0.00	a)
CH0011029946	INFICON HOLDING AG-REG	4'118	726	266	4'578	CHF	1'150.00	5'264'700.00	0.11	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	369'098	44'310	34'701	378'707	CHF	402.00	152'240'214.00	3.32	a)
CH0011108872	MOBIMO HOLDING AG-REG	16'953	1'392	1'464	16'881	CHF	323.00	5'452'563.00	0.12	a)
CH0011115703	CREALOGIX HOLDING AG-REG	1'528	0	0	1'528	CHF	121.00	184'888.00	0.00	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.08.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0011178255	TX GROUP AG	11'193	0	0	11'193	CHF	107.00	1'197'651.00	0.03	a)
CH0011339204	ASCOM HOLDING AG-REG	93'378	3'877	6'301	90'954	CHF	14.56	1'324'290.24	0.03	a)
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	25'886	5'938	0	31'824	CHF	47.80	1'521'187.20	0.03	a)
CH0011484067	ST GALLER KANTONALBANK A-REG	7'618	2'096	1'255	8'459	CHF	426.50	3'607'763.50	0.08	a)
CH0011607683	TORNOS HOLDING AG - REG	24'195	0	0	24'195	CHF	7.24	175'171.80	0.00	a)
CH0011693600	LUZERNER KANTONALBANK AG-REG	8'479	461	282	8'658	CHF	416.00	3'601'728.00	0.08	a)
CH0011795959	DORMAKABA HOLDING AG	7'699	639	504	7'834	CHF	660.50	5'174'357.00	0.11	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	6'050'703	724'240	558'104	6'216'839	CHF	84.79	527'125'778.81	11.49	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1'722'968	207'084	159'020	1'771'032	CHF	367.75	651'297'018.00	14.20	a)
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	29'518	3'428	2'470	30'476	CHF	558.50	17'020'846.00	0.37	a)
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	5'321'960	1'726'743	721'902	6'326'801	CHF	9.71	61'458'544.91	1.34	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	405'841	45'866	45'031	406'676	CHF	50.98	20'732'342.48	0.45	a)
CH0012142631	CLARIANT AG-REG	610'041	54'405	105'537	558'909	CHF	19.28	10'775'765.52	0.23	a)
CH0012214059	HOLCIM LTD	1'259'791	267'865	110'596	1'417'060	CHF	52.20	73'970'532.00	1.61	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	4'476'597	532'408	500'717	4'508'288	CHF	33.92	152'921'128.96	3.33	a)
CH0012255144	SWATCH GROUP AG/THE-REG	132'798	33'086	24'767	141'117	CHF	50.35	7'105'240.95	0.15	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	70'046	6'346	4'750	71'642	CHF	258.20	18'497'964.40	0.40	a)
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	115'126	0	0	115'126	CHF	4.17	480'075.42	0.01	a)
CH0012280076	STRAUMANN HOLDING AG-REG	27'440	3'645	2'664	28'421	CHF	1'770.00	50'305'170.00	1.10	a)
CH0012335540	VONTOBEL HOLDING AG-REG	69'282	5'270	2'682	71'870	CHF	85.70	6'159'259.00	0.13	a)
CH0012410517	BALOISE HOLDING AG - REG	113'479	15'725	12'863	116'341	CHF	146.10	16'997'420.10	0.37	a)
CH0012453913	TEMENOS AG - REG	163'117	17'817	13'524	167'410	CHF	145.40	24'341'414.00	0.53	a)
CH0012530207	BACHEM HOLDING AG-REG B	12'614	1'318	886	13'046	CHF	670.00	8'740'820.00	0.19	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	134'022	15'640	13'631	136'031	CHF	353.00	48'018'943.00	1.05	a)
CH0012684657	BOBST GROUP SA-REG	20'085	2'024	1'238	20'871	CHF	84.45	1'762'555.95	0.04	a)
CH0012829898	EMMI AG-REG	5'073	747	626	5'194	CHF	1'057.00	5'490'058.00	0.12	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	182'810	21'917	16'995	187'732	CHF	775.00	145'492'300.00	3.17	a)
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	10'674	1'331	932	11'073	CHF	884.50	9'794'068.50	0.21	a)
CH0014345117	COMPAGNIE FINANCIERE TRAD-BR	4'319	57	0	4'376	CHF	111.50	487'924.00	0.01	a)
CH0014786500	VALIANT HOLDING AG-REG	39'929	8'629	4'497	44'061	CHF	92.40	4'071'236.40	0.09	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	77'203	11'247	8'008	80'442	CHF	477.60	38'419'099.20	0.84	a)
CH0016440353	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	16'776	1'772	1'380	17'168	CHF	992.50	17'039'240.00	0.37	a)
CH0017875789	JUNGFRAUBAHN HOLDING AG-REG	12'015	592	0	12'607	CHF	144.00	1'815'408.00	0.04	a)
CH0018294154	PSP SWISS PROPERTY AG-REG	113'556	14'787	12'381	115'962	CHF	122.80	14'240'133.60	0.31	a)
CH0019107025	APG SGA SA	4'660	350	853	4'157	CHF	222.50	924'932.50	0.02	a)
CH0019396990	YPSOMED HOLDING AG-REG	10'345	1'210	0	11'555	CHF	146.80	1'696'274.00	0.04	a)
CH0021218067	EVOLVA HOLDING SA	2'047'717	0	0	2'047'717	CHF	0.17	353'845.50	0.01	a)
CH0021545667	VAUDOISE ASSURANCES HOL	2'693	104	164	2'633	CHF	463.00	1'219'079.00	0.03	a)
CH0022268228	EFG INTERNATIONAL AG	210'398	38'046	9'524	238'920	CHF	7.25	1'732'170.00	0.04	a)
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	1'395	111	43	1'463	CHF	2'360.00	3'452'680.00	0.08	a)
CH0023405456	DUFREY AG-REG	113'147	60'101	6'186	167'062	CHF	49.54	8'276'251.48	0.18	a)
CH0023868554	IMPLENIA AG-REG	29'726	6'101	0	35'827	CHF	21.14	757'382.78	0.02	a)
CH0024590272	ALSO HOLDING AG-REG	14'898	2'545	1'453	15'990	CHF	294.50	4'709'055.00	0.10	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	55'813	6'837	5'441	57'209	CHF	1'624.00	92'907'416.00	2.03	a)
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	100'055	13'187	10'915	102'327	CHF	295.80	30'268'326.60	0.66	a)
CH0024638212	SCHINDLER HOLDING AG-REG	47'503	8'129	4'450	51'182	CHF	285.60	14'617'579.20	0.32	a)
CH0024666528	HOCHDORF HOLDING AG	3'422	0	0	3'422	CHF	47.00	160'834.00	0.00	a)
CH0025238863	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	139'568	16'374	12'421	143'521	CHF	335.10	48'093'887.10	1.05	a)
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	13'049	0	1'853	11'196	CHF	132.00	1'477'872.00	0.03	a)
CH0025536027	BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI	7'634	884	594	7'924	CHF	361.50	2'864'526.00	0.06	a)
CH0025607331	ROMANDE ENERGIE HOLDING-REG	414	0	0	414	CHF	1'390.00	575'460.00	0.01	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	421'517	53'916	39'993	435'440	CHF	93.64	40'774'601.60	0.89	a)
CH0027148649	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	34'685	20'000	0	54'685	CHF	2.28	124'408.38	0.00	a)
CH0028422100	BELLEVUE GROUP AG	25'007	1'420	4'576	21'851	CHF	45.20	987'665.20	0.02	a)
CH0029850754	ADDEX THERAPEUTICS LTD	1'502	0	0	1'502	CHF	1.52	2'283.04	0.00	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	91'365	10'193	8'291	93'267	CHF	765.20	71'367'908.40	1.56	a)
CH0030380734	HUBER + SUHNER AG-REG	39'536	4'810	4'462	39'884	CHF	82.10	3'274'476.40	0.07	a)
CH0030486770	DAETWYLER HOLDING AG-BR	18'407	1'775	932	19'250	CHF	327.00	6'294'750.00	0.14	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.08.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0032816131	SF URBAN PROPERTIES AG	1'699	0	0	1'699	CHF	105.00	178'395.00	0.00	a)
CH0033361673	U-BLOX HOLDING AG	17'969	3'089	1'178	19'880	CHF	65.75	1'307'110.00	0.03	a)
CH0038285679	ORASCOM DEVELOPMENT HOLDING	42'058	0	0	42'058	CHF	11.26	473'573.08	0.01	a)
CH0038388911	SULZER AG-REG	43'398	2'555	1'800	44'153	CHF	138.00	6'093'114.00	0.13	a)
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	134'791	17'550	12'019	140'322	CHF	88.70	12'446'561.40	0.27	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	7'064'751	853'843	655'723	7'262'871	CHF	115.74	840'604'689.54	18.33	a)
CH0039542854	MCH GROUP AG	12'889	0	0	12'889	CHF	13.65	175'934.85	0.00	a)
CH0039821084	METALL ZUG AG-SHS B-REG	557	0	50	507	CHF	2'170.00	1'100'190.00	0.02	a)
CH0042615283	ZUR ROSE GROUP AG	23'457	2'759	2'238	23'978	CHF	394.00	9'447'332.00	0.21	a)
CH0043238366	ARYZTA AG	2'480'817	428'198	355'528	2'553'487	CHF	1.28	3'260'802.90	0.07	a)
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	5'000	4'768	0	9'768	CHF	19.70	192'429.60	0.00	a)
CH0100191136	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	4'069'129	293'296	629'694	3'732'731	CHF	0.18	666'292.48	0.01	a)
CH0100837282	KARDEX HOLDING AG-REG	14'639	1'713	936	15'416	CHF	245.50	3'784'628.00	0.08	a)
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	541'096	73'362	53'365	561'093	CHF	62.60	35'124'421.80	0.77	a)
CH0102659627	GAM HOLDING AG	344'139	42'191	39'459	346'871	CHF	1.76	609'452.35	0.01	a)
CH0106213793	POLYPHOR AG	24'141	0	0	24'141	CHF	1.67	40'315.47	0.00	a)
CH0108503795	MEYER BURGER TECHNOLOGY AG	5'135'092	346'541	0	5'481'633	CHF	0.46	2'537'996.08	0.06	a)
CH0110240600	ARBONIA AG	137'884	21'802	16'409	143'277	CHF	19.04	2'727'994.08	0.06	a)
CH0110303119	LECLANCHE SA-REG	194'047	0	0	194'047	CHF	0.88	170'373.27	0.00	a)
CH0111677362	ORIOR AG	18'214	1'440	890	18'764	CHF	94.00	1'763'816.00	0.04	a)
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	24'054	8'840	0	32'894	CHF	65.00	2'138'110.00	0.05	a)
CH0122527648	POENINA HOLDING AG	117	912	0	1'029	CHF	45.70	47'025.30	0.00	a)
CH0126639464	CALIDA HOLDING-REG	9'952	0	0	9'952	CHF	45.40	451'820.80	0.01	a)
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	89'292	12'416	8'146	93'562	CHF	71.35	6'675'648.70	0.15	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	711'331	79'577	64'815	726'093	CHF	84.26	61'180'596.18	1.33	a)
CH0127480363	AUTONEUM HOLDING AG	7'581	1'420	1'011	7'990	CHF	175.30	1'400'647.00	0.03	a)
CH0130293662	BKW AG	50'966	5'289	3'993	52'262	CHF	106.20	5'550'224.40	0.12	a)
CH0148052126	ZUG ESTATES HOLDING AG-B SHR	970	0	0	970	CHF	2'020.00	1'959'400.00	0.04	a)
CH0187624256	IVF HARTMANN HOLDING AG-REG	87	0	0	87	CHF	160.00	13'920.00	0.00	a)
CH0189396655	GLARNER KANTONALBANK	2'268	0	0	2'268	CHF	28.80	65'318.40	0.00	a)
CH0190891181	LEONTEQ AG	25'127	3'842	1'805	27'164	CHF	61.50	1'670'586.00	0.04	a)
CH0208062627	MEIER TOBLER GROUP AG	22'382	0	0	22'382	CHF	19.80	443'163.60	0.01	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1'279'908	152'255	117'012	1'315'151	CHF	101.00	132'830'251.00	2.90	a)
CH0212186248	NOVAVEST REAL ESTATE AG	0	582	0	582	CHF	46.50	27'063.00	0.00	a)
CH0212255803	BURKHALTER HOLDING AG	15'206	0	0	15'206	CHF	66.10	1'005'116.60	0.02	a)
CH0225173167	CEMBRA MONEY BANK AG	73'450	14'190	7'856	79'784	CHF	66.95	5'341'538.80	0.12	a)
CH0231351104	THURGAUER KANTONALBANK-CERT	9'483	0	0	9'483	CHF	107.00	1'014'681.00	0.02	a)
CH0238627142	BOSSARD HOLDING AG-REG A	13'792	1'163	466	14'489	CHF	308.00	4'462'612.00	0.10	a)
CH0239229302	SFS GROUP AG	41'946	4'325	3'143	43'128	CHF	130.80	5'641'142.40	0.12	a)
CH0239518779	HIAG IMMOBILIEN AG	11'602	0	500	11'102	CHF	101.50	1'126'853.00	0.02	a)
CH0244017502	BYSTRONIC AG	3'664	439	250	3'853	CHF	1'288.00	4'962'664.00	0.11	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	8'791'513	1'035'582	1'019'905	8'807'190	CHF	15.28	134'573'863.20	2.93	a)
CH0256379097	MOLECULAR PARTNERS AG	61'208	12'802	8'173	65'837	CHF	19.32	1'271'970.84	0.03	a)
CH0273774791	INTERSHOP HOLDING AG	3'059	353	306	3'106	CHF	620.00	1'925'720.00	0.04	a)
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-RG	25'469	6'171	4'744	26'896	CHF	99.00	2'662'704.00	0.06	a)
CH0276837694	MOBILEZONE HOLDING AG-REG	120'520	21'958	16'501	125'977	CHF	12.94	1'630'142.38	0.04	a)
CH0284142913	PLAZZA AG-REG A	3'510	0	0	3'510	CHF	334.00	1'172'340.00	0.03	a)
CH0305285295	VARIA US PROPERTIES AG	3'750	0	0	3'750	CHF	39.30	147'375.00	0.00	a)
CH0305951201	WALLISER KANTONALBANK-REG	7'544	0	0	7'544	CHF	103.00	777'032.00	0.02	a)
CH0311864901	VAT GROUP AG	65'888	7'914	6'049	67'753	CHF	383.60	25'990'050.80	0.57	a)
CH0312309682	ZUEBLIN IMMOBILIEN HOLDI-REG	1'964	0	0	1'964	CHF	27.80	54'599.20	0.00	a)
CH0314029270	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	52'801	100'869	0	153'670	CHF	1.44	220'516.45	0.00	a)
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	5'916	612	489	6'039	CHF	285.00	1'721'115.00	0.04	a)
CH0319416936	FLUGHAFEN ZURICH AG-REG	46'953	4'731	3'709	47'975	CHF	152.20	7'301'795.00	0.16	a)
CH0325094297	INVESTIS HOLDING SA	14'910	0	1'200	13'710	CHF	99.80	1'368'258.00	0.03	a)
CH0325814116	KUROS BIOSCIENCES AG-REG	24'399	0	0	24'399	CHF	2.46	60'021.54	0.00	a)
CH0346177709	OBSEVA SA	117'953	52'959	0	170'912	USD	2.93	458'044.08	0.01	a)
CH0350494719	BANQUE CANTONALE DE GENEV-BR	1'815	125	0	1'940	CHF	168.00	325'920.00	0.01	a)

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.03.2021	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. 31.08.2021	Wahrung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0350665672	BANQUE CANTONALE DU JURA-REG	174	0	0	174	CHF	51.00	8'874.00	0.00	a)
CH0360674466	GALENICA AG	123'745	16'168	11'385	128'528	CHF	71.65	9'209'031.20	0.20	a)
CH0360826991	COMET HOLDING AG-REG	18'908	2'096	1'767	19'237	CHF	347.50	6'684'857.50	0.15	a)
CH0363463438	IDORSIA LTD	269'230	38'903	27'697	280'436	CHF	21.60	6'057'417.60	0.13	a)
CH0364749348	VIFOR PHARMA AG	116'058	13'878	12'417	117'519	CHF	130.40	15'324'477.60	0.33	a)
CH0367427686	VALARTIS GROUP AG-BR	509	0	0	509	CHF	9.30	4'733.70	0.00	a)
CH0371153492	LANDIS+GYR GROUP AG	52'773	3'864	1'648	54'989	CHF	70.15	3'857'478.35	0.08	a)
CH0386200239	MEDARTIS HOLDING AG	12'517	2'208	2'500	12'225	CHF	126.60	1'547'685.00	0.03	a)
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	14'221	0	0	14'221	CHF	3.40	48'351.40	0.00	a)
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	26'089	1'934	0	28'023	CHF	115.20	3'228'249.60	0.07	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	348'240	40'400	31'461	357'179	CHF	330.10	117'904'787.90	2.57	a)
CH0420462266	KLINGELNBERG AG	13'717	0	0	13'717	CHF	17.65	242'105.05	0.01	a)
CH0432492467	ALCON INC	1'230'088	140'973	112'432	1'258'629	CHF	75.44	94'950'971.76	2.07	a)
CH0435377954	SIG COMBIBLOC GROUP AG	694'868	185'465	68'756	811'577	CHF	28.04	22'756'619.08	0.50	a)
CH0453226893	ALUFLEXPACK AG	15'806	2'667	0	18'473	CHF	35.00	646'555.00	0.01	a)
CH0460027110	BLACKSTONE RESOURCES AG	37'233	0	0	37'233	CHF	3.56	132'549.48	0.00	a)
CH0466642201	HELVETIA HOLDING AG-REG	85'766	10'914	8'514	88'166	CHF	104.90	9'248'613.40	0.20	a)
CH0468525222	MEDACTA GROUP SA	14'579	1'012	0	15'591	CHF	143.00	2'229'513.00	0.05	a)
CH0478634105	AEVIS VICTORIA SA	14'125	0	0	14'125	CHF	12.90	182'212.50	0.00	a)
CH0493891243	ZUGER KANTONALBANK-BR	396	0	0	396	CHF	6'820.00	2'700'720.00	0.06	a)
CH0496451508	SOFTWAREONE HOLDING AG	254'644	25'903	15'964	264'583	CHF	25.90	6'852'699.70	0.15	a)
CH0524026959	INA INVEST HOLDING AG	18'675	0	0	18'675	CHF	18.58	346'981.50	0.01	a)
CH0527044959	BERGBAHNEN ENGELB. TRUEB-REG	120	0	0	120	CHF	45.80	5'496.00	0.00	a)
CH0528751586	VZ HOLDING AG	39'264	3'099	871	41'492	CHF	87.00	3'609'804.00	0.08	a)
CH0530235594	VETROPACK HOLDING-REGISTERED	32'404	2'648	0	35'052	CHF	62.50	2'190'750.00	0.05	a)
CH0531751755	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	70'629	14'735	10'702	74'662	CHF	77.70	5'801'237.40	0.13	a)
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	7'242	1'164	1'502	6'904	CHF	145.80	1'006'603.20	0.02	a)
CH0582581713	DOTTIKON ES HOLDING AG-REG	0	4'172	0	4'172	CHF	310.00	1'293'320.00	0.03	a)
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	0	26'372	1'487	24'885	CHF	477.50	11'882'587.50	0.26	a)
CH1110425654	MONTANA AEROSPACE AG	0	41'343	0	41'343	CHF	37.85	1'564'832.55	0.03	a)
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	0	30'738	1'645	29'093	CHF	132.80	3'863'550.40	0.08	a)
NL0010733960	LASTMINUTE.COM NV	14'863	2'099	2'800	14'162	CHF	36.40	515'496.80	0.01	a)
<b>CH</b>								<b>4'485'204'985.59</b>	<b>97.79</b>	
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	48'846	0	0	48'846	CHF	2.06	100'622.76	0.00	a)
IT0005108359	CASSIOPEA SPA	14'711	0	0	14'711	CHF	41.20	606'093.20	0.01	a)
<b>IT</b>								<b>706'715.96</b>	<b>0.02</b>	
LI0315487269	VP BANK AG-A	8'711	350	540	8'521	CHF	102.80	875'958.80	0.02	a)
LI0355147575	LIECHTENSTEIN LANDESBANK	33'359	0	3'645	29'714	CHF	53.80	1'598'613.20	0.03	a)
<b>LI</b>								<b>2'474'572.00</b>	<b>0.05</b>	
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	17'258	3'552	0	20'810	CHF	83.80	1'743'878.00	0.04	a)
<b>NL</b>								<b>1'743'878.00</b>	<b>0.04</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH1110994071	3.0000 % CS 3 11/12/21 B	0	1'945	1'945	0	CHF	0.00 %	0.00	0.00	
<b>GG</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Bezugsrechte</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
CH0587069664	SWISS STEEL HOLDING AG-RTS	0	1'078'648	1'078'648	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0598285952	FUNDAMENTA REAL ESTATE-RTS	0	5'000	5'000	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1111011453	CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	0	5'278'266	5'278'266	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH1117398706	NOVAVEST REAL ESTATE AG	0	534	534	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Futures</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
03/21	SWISS MKT IX FUTR MAR21	124	83	207	0 CHF	0.00	0.00	0.00
03/21	SWISS MID CAP FUT MAR21	162	0	162	0 CHF	0.00	0.00	0.00
06/21	SWISS MKT IX FUTR JUN21	0	593	593	0 CHF	0.00	0.00	0.00
06/21	SWISS MID CAP FUT JUN21	0	188	188	0 CHF	0.00	0.00	0.00
09/21	SWISS MKT IX FUTR SEP21	0	488	241	247 CHF	0.00	0.00	0.00 a)
09/21	SWISS MID CAP FUT SEP21	0	177	0	177 CHF	0.00	0.00	0.00 a)

<b>Vermögensaufstellung</b>	<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
Bankguthaben auf Sicht	50'400'676.05	1.10
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	4'504'617'876.80	98.21
Sonstige Vermögenswerte	31'685'596.44	0.69
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'704'149.29</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-145'542.36	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>4'586'558'606.93</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>	<b>Kurswert CHF</b>	<b>in % 7)</b>
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);	4'504'617'876.80	98.21
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

ISIN	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 31.08.2021	Wäh- rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % (7)
<b>Ausgeliehene Effekten</b>					<b>32'318'707.02</b>	<b>0.70</b>
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>					<b>32'318'707.02</b>	<b>0.70</b>
CH0001319265	SCHWEIZERISCH NATIONALBA-REG	185	CHF	5'300.00	980'500.00	0.02
CH0001624714	CPH CHEMIE & PAPIER HLDG-REG	304	CHF	66.40	20'185.60	0.00
CH0002178181	STADLER RAIL AG	47'954	CHF	39.68	1'902'814.72	0.04
CH0003390066	MIKRON HOLDING AG-REG NEW	2'981	CHF	7.28	21'701.68	0.00
CH0003420806	ORELL FUSSLI HOLDING AG-REG	10	CHF	93.00	930.00	0.00
CH0003671440	RIETER HOLDING AG-REG	1'500	CHF	220.00	330'000.00	0.01
CH0008702190	CICOR TECHNOLOGIES-REG	2'000	CHF	61.00	122'000.00	0.00
CH0010570767	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	70	CHF	10'770.00	753'900.00	0.02
CH0011432447	BASILEA PHARMACEUTICA-REG	7'203	CHF	47.80	344'303.40	0.01
CH0011607683	TORNOS HOLDING AG - REG	24'000	CHF	7.24	173'760.00	0.00
CH0012268360	KUDELSKI SA-BR	115'126	CHF	4.17	480'075.42	0.01
CH0012280076	STRAUMANN HOLDING AG-REG	382	CHF	1'770.00	676'140.00	0.01
CH0012829898	EMMI AG-REG	3'721	CHF	1'057.00	3'933'097.00	0.09
CH0025343259	COLTENE HOLDING AG-REG	2'000	CHF	132.00	264'000.00	0.01
CH0027148649	SANTHERA PHARMACEUTICALS-REG	54'684	CHF	2.28	124'406.10	0.00
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	1'300	CHF	765.20	994'760.00	0.02
CH0038389992	BB BIOTECH AG-REG	9'006	CHF	88.70	798'832.20	0.02
CH0038863350	NESTLE SA-REG	19'200	CHF	115.74	2'222'208.00	0.05
CH0042615283	ZUR ROSE GROUP AG	15'300	CHF	394.00	6'028'200.00	0.13
CH0045825517	FUNDAMENTA REAL ESTATE	5'000	CHF	19.70	98'500.00	0.00
CH0100191136	RELIEF THERAPEUTICS HOLDING	3'729'434	CHF	0.18	665'703.97	0.01
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	30'000	CHF	62.60	1'878'000.00	0.04
CH0118530366	PEACH PROPERTY GROUP AG	20'381	CHF	65.00	1'324'765.00	0.03
CH0244017502	BYSTRONIC AG	216	CHF	1'288.00	278'208.00	0.01
CH0314029270	WISEKEY INTERNATIONAL HOLDIN	150'000	CHF	1.44	215'250.00	0.00
CH0315966322	BELL FOOD GROUP AG - REG	3'000	CHF	285.00	855'000.00	0.02
CH0346177709	OBSEVA SA	162'000	USD	2.93	434'159.93	0.01
CH0363463438	IDORSIA LTD	138'219	CHF	21.60	2'985'530.40	0.07
CH0404880129	ASMALLWORLD AG	1'884	CHF	3.40	6'405.60	0.00
CH0460027110	BLACKSTONE RESOURCES AG	37'000	CHF	3.56	131'720.00	0.00
CH0542483745	V-ZUG HOLDING AG	3'000	CHF	145.80	437'400.00	0.01
CH11101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	1'500	CHF	477.50	716'250.00	0.02
CH1110760852	POLYPEPTIDE GROUP AG	2'000	CHF	132.80	265'600.00	0.01
IT0004147952	NEWRON PHARMACEUTICALS SPA	30'000	CHF	2.06	61'800.00	0.00
IT0005108359	CASSIOPEA SPA	13'000	CHF	41.20	535'600.00	0.01
NL0011832936	COSMO PHARMACEUTICALS NV	15'000	CHF	83.80	1'257'000.00	0.03

#### Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

#### Umrechnungskurse

EUR	1 = CHF	1.08135705
USD	1 = CHF	0.91605000

## Collateral ausgeliehene Effekten

Collateral in Fondswährung	Aktien	Obligationen
33'835'899.42	16.81%	9.31%

Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihe: 0.00 22) 24)

## Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	36'867'150.50	0.80
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	0.00	0.00

\* 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.

## Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Ausgabespesen in % des Nettoinventar- wertes	Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Durchschnitt der angewandten Rücknahme- spesen in % des Nettoinventar- wertes
	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	
01.03.2020 – 28.02.2021	0.00 - 0.02	0.00	0.004	0.00 - 0.02	0.00	0.006

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. 4 geregelt.

## Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten: 32'318'707.02

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten: 0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements: Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten soft commissions geschlossen.

## Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF	max. PVK p.a.	max. VK Zielfonds p.a.
DT CHF	01.03.2020 – 28.02.2021	0.15 %	0.10 %	0.05 %	0.40 %	3.00 %
FA CHF	01.03.2020 – 28.02.2021	0.15 %	0.05 %	0.10 %	0.50 %	3.00 %
GT CHF	01.03.2020 – 28.02.2021	0.14 %	0.09 %	0.05 %	0.35 %	3.00 %
MT CHF	01.03.2020 – 28.02.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	3.00 %
NT CHF	01.03.2020 – 28.02.2021	0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %	3.00 %

Gemäss Richtlinie für Pflichten im Zusammenhang mit der Erhebung von Gebühren und der Belastung von Kosten sowie deren Verwendung (Transparenzrichtlinie) vom 22. Mai 2014 (in Kraft 1. Juli 2014): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Teilvermögens bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Teilvermögens. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Teilvermögen belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

## Benchmark

Swiss Performance Index (SPI®)

## TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der SFAMA - Swiss Funds & Asset Management Association (Stand: 20. April 2015) herausgegeben wurden, ermittelt.

## Erklärung der Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt
- 24) In Cash hinterlegtes Collateral: CHF 25'000'000.00

## 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 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) 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 1/100 (zwei Stellen nach dem Komma) der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, 1/10'000 (vier Stellen nach dem Komma) 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 Kommissionsätze 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.