

# SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND RESPONSIBLE WORLD 45

## Halbjahresbericht per 31.07.2023

Teilvermögens des Swisscanto (CH) Portfolio Fund II  
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Effektenfonds»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	1559097	CHF
BA CHF	20594887	CHF
DT CHF	35899428	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Collateral ausgeliehene Effekten	15
5	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	16
6	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
7	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	16
8	Pauschale Verwaltungskommission	17
9	Benchmark	17
10	TER	17
11	Fussnoten	18
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	19

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)  
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	01.02.2023	01.02.2022	01.02.2021	01.02.2020
	bis	31.07.2023	31.01.2023	31.01.2022	31.01.2021
<b>Konsolidiert</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		100'347'217.48	103'737'950.59	110'066'456.63	104'619'892.01
<b>Klasse AA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		74'333'133.88	76'353'708.08	88'515'066.44	103'827'773.02
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		736'352.501	753'533.410	791'445.366	975'655.305
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		100.9478	101.3276	111.8398	106.4200
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		100.7963	101.1148	111.7727	106.3500
Ausschüttung je Anteil		-	0.45	0.60	0.60
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.15 %	1.15 %	1.15 %	1.15 %
<b>Klasse BA CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'637'707.70	2'421'241.57	956'842.74	772'494.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		25'052.956	22'853.900	8'189.114	6'943.011
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		105.2853	105.9444	116.8433	111.2600
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		105.1274	105.7219	116.7732	111.2000
Ausschüttung je Anteil		-	0.95	1.00	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.73 %	0.73 %	0.73 %	0.73 %
<b>Klasse DT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		23'376'375.90	24'963'000.94	20'594'547.45	19'624.96
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		214'519.982	229'098.982	172'496.982	173.982
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1) 23)		108.9706	108.9616	119.3908	112.8000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 23)		108.8072	108.7328	119.3191	112.7300
Thesaurierung je Anteil		-	1.04	1.25	1.29
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.60 %	0.60 %	0.60 %	0.60 %

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

### Performance

	YTD / 31.07.2023	2022	2021	2020
Klasse AA CHF	3.77 %	-14.61 %	8.06 %	1.83 %
Klasse BA CHF	4.02 %	-14.25 %	8.51 %	2.26 %
Klasse DT CHF	4.07 %	-13.98 %	8.65 %	2.39 %

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.

## Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.07.2023	31.01.2023
Bankguthaben auf Sicht	1'506'503.11	5'165'851.16
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	34'839'297.42	36'098'036.66
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	34'919'965.00	36'615'260.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	28'382'989.67	25'512'148.82
Sonstige Vermögenswerte	788'318.09	439'955.51
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>100'437'073.29</b>	<b>103'831'252.15</b>
Andere Verbindlichkeiten	-89'855.81	-93'301.56
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>100'347'217.48</b>	<b>103'737'950.59</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse AA CHF	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		753'533.410	791'445.366
Ausgegebene Anteile		12'963.092	33'125.197
Zurückgenommene Anteile		-30'144.001	-71'037.153
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>736'352.501</b>	<b>753'533.410</b>

Klasse BA CHF	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		22'853.900	8'189.114
Ausgegebene Anteile		4'430.652	14'683.357
Zurückgenommene Anteile		-2'231.596	-18.571
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>25'052.956</b>	<b>22'853.900</b>

Klasse DT CHF	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		229'098.982	172'496.982
Ausgegebene Anteile		19'088.000	86'190.000
Zurückgenommene Anteile		-33'667.000	-29'588.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>214'519.982</b>	<b>229'098.982</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.02.2023 31.07.2023	01.02.2022 31.01.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		103'737'950.59	110'066'456.63
Ausbezahlte Ausschüttung		-358'683.82	-479'938.09
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-83'383.89	-91'548.48
Saldo aus dem Anteilverkehr		-3'061'854.41	4'104'166.62
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		113'189.01	-9'861'186.09
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>100'347'217.48</b>	<b>103'737'950.59</b>

## Erfolgsrechnung

<b>Konsolidiert</b>	<b>von bis</b>	<b>01.02.2023 31.07.2023</b>	<b>01.02.2022 31.01.2023</b>
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		13'619.94	3'897.25
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-1'150.84	-15'281.77
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		632'859.72	903'974.32
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		217'350.30	625'532.02
Erträge der Gratisaktien		27.58	950.57
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		508'416.97	79'037.40
Erträge aus Wertpapierleihe		4'765.85	11'205.90
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		19'831.80	81'373.33
<b>Total Ertrag</b>		<b>1'395'721.32</b>	<b>1'690'689.02</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-26.27	0.00
Reglementarische Vergütungen		-509'596.87	-1'068'614.83
Sonstige Aufwendungen		-472.50	-759.01
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-43'818.76	-56'021.05
<b>Total Aufwand</b>		<b>-553'914.40</b>	<b>-1'125'394.89</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>841'806.92</b>	<b>565'294.13</b>
<hr/>			
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-934'193.13	-984'838.95
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		27'247.54	38'260.08
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		11'526.46	23'344.93
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>-53'612.21</b>	<b>-357'939.81</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		166'801.22	-9'503'246.28
<b>Gesamterfolg</b>		<b>113'189.01</b>	<b>-9'861'186.09</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind</b>							<b>69'759'262.42</b>	<b>69.46</b>	
<b>Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte</b>							<b>34'839'297.42</b>	<b>34.69</b>	
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	45	129	17	157 USD	1'238.05	168'492.97	0.17	a)
<b>AR</b>							<b>168'492.97</b>	<b>0.17</b>	
AT0000746409	VERBUND AG	0	726	726	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>AT</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
AU000000ALL7	ARISTOCRAT LEISURE LTD	4'923	2'413	1'986	5'350 AUD	39.33	122'909.35	0.12	a)
AU000000APA1	APA GROUP	6'114	0	0	6'114 AUD	10.00	35'713.52	0.04	a)
AU000000BHP4	BHP GROUP LTD	2'030	1'304	3'334	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000MIN4	MINERAL RESOURCES LTD	519	435	954	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU000000QBE9	QBE INSURANCE GROUP LTD	9'076	0	0	9'076 AUD	15.77	83'605.21	0.08	a)
AU000000TSL2	TELSTRA GROUP LTD	10'772	32'750	0	43'522 AUD	4.26	108'299.29	0.11	a)
AU000000WBC1	WESTPAC BANKING CORP	6'777	0	6'777	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
AU0000154833	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	0	6'769	0	6'769 AUD	6.08	24'040.05	0.02	a)
<b>AU</b>							<b>374'567.42</b>	<b>0.37</b>	
BE0003470755	SOLVAY SA	0	178	178	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003565737	KBC GROUP NV	456	431	456	431 EUR	68.40	28'175.71	0.03	a)
BE0003739530	UCB SA	0	209	209	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974264930	AGEAS	0	694	694	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>BE</b>							<b>28'175.71</b>	<b>0.03</b>	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	2'960	12'092	13'546	1'506 CAD	19.92	19'756.95	0.02	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	2'716	0	2'716	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1'286	0	1'286	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3495531079	FORTIS INC	0	2'566	0	2'566 CAD	56.21	94'989.55	0.09	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	857	0	857	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	4'035	1'160	5'195	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	0	302	0	302 CAD	91.36	18'170.57	0.02	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	1'105	0	1'105	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA5503721063	LUNDIN MINING CORP	0	3'752	3'752	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	8'945	0	8'945 CAD	26.36	155'285.65	0.15	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	1'311	0	0	1'311 CAD	103.28	89'171.18	0.09	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	814	0	814	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	1'805	922	1'805	922 CAD	56.64	34'392.18	0.03	a)
CA7677441056	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	0	327	327	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA87262K1057	TMX GROUP LTD	0	1'590	1'590	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	217	1'212	0	1'429 CAD	151.85	142'906.70	0.14	a)
<b>CA</b>							<b>554'672.78</b>	<b>0.55</b>	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	0	185	0	185 CHF	560.40	103'674.00	0.10	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	66	66	0	132 CHF	2'939.00	387'948.00	0.39	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2'187	148	0	2'335 CHF	420.80	982'568.00	0.98	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	28'211	335	3'451	25'095 CHF	91.07	2'285'401.65	2.28	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9'456	582	270	9'768 CHF	270.60	2'643'220.80	2.63	a)
CH0012214059	HOLCIT LTD	4'865	0	0	4'865 CHF	60.60	294'819.00	0.29	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	21'164	0	5'090	16'074 CHF	34.86	560'339.64	0.56	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	1'059	181	534	706 CHF	242.50	171'205.00	0.17	a)
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	1'462	95	0	1'557 CHF	505.20	786'596.40	0.78	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	254	326	0	580 CHF	552.80	320'624.00	0.32	a)
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	402	31	0	433 CHF	978.00	423'474.00	0.42	a)
CH0025751329	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6'014	0	6'014	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	327	0	116	211 CHF	493.40	104'107.40	0.10	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	36'690	1'668	1'092	37'266 CHF	106.88	3'982'990.08	3.97	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	2'783	0	675	2'108 CHF	90.90	191'617.20	0.19	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	7'262	859	640	7'481 CHF	140.30	1'049'584.30	1.05	a)



ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	49'939	0	4'304	45'635 CHF	19.28	879'614.63	0.88	a)
CH0418792922	SIKA AG-REG	1'190	165	0	1'355 CHF	270.70	366'798.50	0.37	a)
CH0432492467	ALCON INC	8'553	2'549	0	11'102 CHF	74.04	821'992.08	0.82	a)
<b>CH</b>							<b>16'356'574.68</b>	<b>16.29</b>	
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	689	0	689 EUR	63.54	41'841.56	0.04	a)
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	1'391	0	845	546 EUR	70.18	36'622.46	0.04	a)
DE0006599905	MERCK KGAA	615	0	615	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	0	3'309	0	3'309 EUR	38.59	122'043.03	0.12	a)
DE0007164600	SAP SE	515	0	515	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	1'448	0	174	1'274 EUR	154.98	188'706.36	0.19	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	0	2'820	0	2'820 EUR	9.18	24'736.52	0.02	a)
DE000ZAL1111	ZALANDO SE	0	896	896	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>DE</b>							<b>413'949.93</b>	<b>0.41</b>	
DK0060252690	PANDORA A/S	853	0	853	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	0	825	0	825 DKK	1'092.20	115'557.56	0.12	a)
DK0060738599	WILLIAM DEMANT HOLDING	1'255	0	1'255	0 DKK	0.00	0.00	0.00	
<b>DK</b>							<b>115'557.56</b>	<b>0.12</b>	
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	8'093	0	8'093	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0148396007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	2'241	0	0	2'241 EUR	34.81	74'556.81	0.07	a)
ES0173093024	REDEIA CORP SA	4'287	2'488	0	6'775 EUR	15.21	98'454.87	0.10	a)
<b>ES</b>							<b>173'011.68</b>	<b>0.17</b>	
FI0009000202	KESKO OYJ-B SHS	5'071	0	5'071	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009013296	NESTE OYJ	0	416	416	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FI0009014575	METSO OUTOTEC OYJ	0	2'542	0	2'542 EUR	10.33	25'084.59	0.02	a)
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	13'752	0	850	12'902 SEK	119.08	126'747.80	0.13	a)
<b>FI</b>							<b>151'832.39</b>	<b>0.15</b>	
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	0	165	0	165 EUR	163.36	25'761.50	0.03	a)
FR0000120628	AXA SA	6'440	0	443	5'997 EUR	27.97	160'312.71	0.16	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	79	30	0	109 EUR	848.10	88'351.72	0.09	a)
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	0	1'142	708	434 EUR	162.04	67'213.02	0.07	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	6'695	1'301	4'860	3'136 EUR	24.72	74'076.10	0.07	a)
FR0000131104	BNP PARIBAS	3'092	438	685	2'845 EUR	60.02	163'199.83	0.16	a)
FR0010208488	ENGIE	2'407	0	2'407	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013176526	VALEO	0	5'960	0	5'960 EUR	20.55	117'057.58	0.12	a)
<b>FR</b>							<b>695'972.46</b>	<b>0.69</b>	
AU000000RIO1	RIO TINTO LTD	938	0	938	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	4'327	0	0	4'327 GBP	747.40	36'069.85	0.04	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	18'222	0	2'947	15'275 GBP	646.30	110'108.23	0.11	a)
GB0006776081	PEARSON PLC	3'139	0	3'139	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0031348658	BARCLAYS PLC	83'614	0	5'170	78'444 GBP	154.96	135'576.28	0.13	a)
GB0031743007	BURBERRY GROUP PLC	4'623	551	285	4'889 GBP	2'223.00	121'217.10	0.12	a)
GB00B033F229	CENTRICA PLC	0	12'862	0	12'862 GBP	138.05	19'803.83	0.02	a)
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	3'176	800	261	3'715 GBP	4'191.00	173'652.43	0.17	a)
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	0	976	0	976 USD	63.39	53'630.83	0.05	a)
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	47'049	0	2'908	44'141 GBP	244.30	120'273.51	0.12	a)
GB00BP6MXD84	SHELL PLC	4'384	0	271	4'113 GBP	2'366.00	108'537.00	0.11	a)
IE00BDB6Q211	WILLIS TOWERS WATSON PLC	200	0	200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
IE00BLS09M33	PENTAIR PLC	2'158	0	2'158	0 USD	0.00	0.00	0.00	
JE00B8KF9B49	WPP PLC	0	2'589	2'589	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
<b>GB</b>							<b>878'869.06</b>	<b>0.88</b>	
BMG2178K1009	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	0	3'500	3'500	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0000063609	SWIRE PROPERTIES LTD	0	9'000	0	9'000 HKD	19.50	19'507.38	0.02	a)
HK0019000162	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	7'500	7'500	0	15'000 HKD	64.95	108'290.95	0.11	a)
KYG9593A1040	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	11'000	0	11'000	0 HKD	0.00	0.00	0.00	
<b>HK</b>							<b>127'798.33</b>	<b>0.13</b>	
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	600	0	600	0 USD	0.00	0.00	0.00	
<b>IE</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	0	2'506	0	2'506 EUR	12.12	29'028.54	0.03	a)
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	45'513	0	4'145	41'368 EUR	2.63	103'943.31	0.10	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	4'213	0	0	4'213 EUR	10.40	41'855.97	0.04	a)
IT0004965148	MONCLER SPA	0	425	0	425 EUR	65.72	26'694.88	0.03	a)
<b>IT</b>							<b>201'522.70</b>	<b>0.20</b>	
JP3119600009	AJINOMOTO CO INC	0	1'800	1'800	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3143600009	ITOCHU CORP	0	2'400	0	2'400 JPY	5'750.00	84'195.73	0.08	a)
JP3160400002	EISAI CO LTD	500	800	1'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164720009	RENESAS ELECTRONICS CORP	2'800	6'800	0	9'600 JPY	2'755.50	161'392.24	0.16	a)
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	2'700	0	0	2'700 JPY	6'291.00	103'632.13	0.10	a)
JP3165700000	NTT DATA GROUP CORP	0	1'400	1'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	1'200	4'800	0	6'000 JPY	2'601.50	95'232.69	0.09	a)
JP3200450009	ORIX CORP	6'000	0	6'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3228600007	KANSAI ELECTRIC POWER CO INC	0	2'000	2'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3258000003	KIRIN HOLDINGS CO LTD	2'600	0	2'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3283460008	KOEI TECMO HOLDINGS CO LTD	0	1'600	1'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3294460005	INPEX CORP	8'700	7'200	15'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3351100007	SYSMEX CORP	0	300	300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3371200001	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	0	3'700	0	3'700 JPY	4'679.00	105'624.77	0.11	a)
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	9'100	36'800	0	45'900 JPY	438.10	122'686.54	0.12	a)
JP3409000001	SUMITOMO REALTY & DEVELOPMEN	2'200	0	2'200	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	2'400	3'000	5'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3496400007	KDDI CORP	1'900	0	1'900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	0	9'200	1'400	7'800 JPY	3'225.00	153'474.18	0.15	a)
JP3626800001	LIXIL CORP	3'300	0	3'300	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	1'500	1'900	3'400	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3726800000	JAPAN TOBACCO INC	0	1'000	0	1'000 JPY	3'153.00	19'236.89	0.02	a)
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	1'500	0	1'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762800005	NOMURA RESEARCH INSTITUTE LT	0	1'100	1'100	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	3'800	1'900	3'800	1'900 JPY	3'523.00	40'839.20	0.04	a)
JP3774200004	HANKYU HANSHIN HOLDINGS INC	0	900	900	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	1'000	0	1'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	0	1'000	0	1'000 JPY	4'513.00	27'534.44	0.03	a)
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	0	4'800	0	4'800 JPY	5'292.00	154'978.72	0.15	a)
JP3893200000	MITSUI FUDOSAN CO LTD	2'700	0	2'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3899600005	MITSUBISHI ESTATE CO LTD	2'000	2'600	4'600	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3933800009	Z HOLDINGS CORP	0	7'000	7'000	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	5'900	0	700	5'200 JPY	2'080.50	66'005.79	0.07	a)
JP3942600002	YAMAHA CORP	1'700	0	1'700	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3970300004	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	1'500	0	1'500	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
<b>JP</b>							<b>1'134'833.32</b>	<b>1.13</b>	
NL0000009082	KONINKLUKE KPN NV	0	39'043	0	39'043 EUR	3.29	122'841.32	0.12	a)
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	1'183	0	185	998 EUR	114.20	108'927.64	0.11	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	0	222	222	0 USD	0.00	0.00	0.00	
NL0010273215	ASML HOLDING NV	215	0	215	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0013267909	AKZO NOBEL N.V.	800	0	800	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>NL</b>							<b>231'768.96</b>	<b>0.23</b>	
NO0010096985	EQUINOR ASA	2'795	0	0	2'795 NOK	308.40	73'860.09	0.07	a)
<b>NO</b>							<b>73'860.09</b>	<b>0.07</b>	
NZTELE000154	SPARK NEW ZEALAND LTD	18'684	0	18'684	0 NZD	0.00	0.00	0.00	
<b>NZ</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
PTGALOAM0009	GALP ENERGIA SGPS SA	0	2'632	2'632	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>PT</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
SE0000115420	VOLVO AB-A SHS	0	4'768	0	4'768 SEK	238.60	93'853.67	0.09	a)
SE0000667925	TELIA CO AB	14'579	0	14'579	0 SEK	0.00	0.00	0.00	
<b>SE</b>							<b>93'853.67</b>	<b>0.09</b>	
SG1R89002252	CITY DEVELOPMENTS LTD	9'600	0	9'600	0 SGD	0.00	0.00	0.00	
SG1S04926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	7'600	6'700	900	13'400 SGD	13.30	116'350.36	0.12	a)
<b>SG</b>							<b>116'350.36</b>	<b>0.12</b>	
BMG491BT1088	INVESCO LTD	0	2'729	0	2'729 USD	16.80	39'742.65	0.04	a)
GB00BFBMT84	SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	730	0	730	0 USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
GB00BMVP7Y09	ROYALTY PHARMA PLC- CL A	0	1'442	0	1'442 USD	31.38	39'224.93	0.04	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	432	684	107	1'009 USD	205.32	179'583.48	0.18	a)
IE00BY7QL619	JOHNSON CONTROLS INTERNATION	1'904	0	1'015	889 USD	69.55	53'597.29	0.05	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	564	0	564	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00206R1023	AT&T INC	2'158	1'739	2'438	1'459 USD	14.52	18'363.94	0.02	a)
US00724F1012	ADOBE INC	391	107	0	498 USD	546.17	235'776.84	0.23	a)
US00751Y1064	ADVANCE AUTO PARTS INC	200	0	200	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0079031078	ADVANCED MICRO DEVICES	1'171	0	1'171	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	353	0	353	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0126531013	ALBEMARLE CORP	0	78	78	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	786	0	786	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC	5'570	740	0	6'310 USD	30.54	167'048.41	0.17	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	4'504	0	621	3'883 USD	132.72	446'732.67	0.44	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	2'122	540	132	2'530 USD	133.68	293'177.69	0.29	a)
US0311621009	AMGEN INC	0	330	0	330 USD	234.15	66'981.07	0.07	a)
US03662Q1058	ANSYS INC	0	460	0	460 USD	342.10	136'412.72	0.14	a)
US0367521038	ANTHEM INC	128	0	128	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0378331005	APPLE INC	5'600	0	873	4'727 USD	196.45	804'973.51	0.80	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	1'072	604	1'676	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	420	145	565	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0404131064	ARISTA NETWORKS INC	437	0	70	367 USD	155.09	49'339.39	0.05	a)
US0533321024	AUTOZONE INC	14	34	0	48 USD	2'481.72	103'261.39	0.10	a)
US0536111091	AVERY DENNISON CORP	152	760	0	912 USD	184.01	145'472.27	0.14	a)
US05464C1018	AXON ENTERPRISE INC	0	295	0	295 USD	185.93	47'546.16	0.05	a)
US0640581007	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	3'795	764	309	4'250 USD	45.36	167'111.34	0.17	a)
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	0	664	664	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	434	0	434	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US09062X1037	BIOGEN INC	663	0	52	611 USD	270.19	143'104.88	0.14	a)
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	30	43	0	73 USD	2'970.80	187'992.37	0.19	a)
US0997241064	BORGWARNER INC	3'975	401	664	3'712 USD	46.50	149'625.24	0.15	a)
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2'164	0	134	2'030 USD	62.19	109'436.09	0.11	a)
US11135F1012	BROADCOM INC	137	142	0	279 USD	898.65	217'339.54	0.22	a)
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	1'732	237	1'969	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1255231003	THE CIGNA GROUP	143	0	143	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1266501006	CVS HEALTH CORP	607	0	607	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1273871087	CADENCE DESIGN SYS INC	1'062	0	218	844 USD	234.01	171'206.72	0.17	a)
US1344291091	CAMPBELL SOUP CO	2'079	1'361	335	3'105 USD	45.82	123'327.70	0.12	a)
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	940	0	940	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC	394	0	0	394 USD	91.47	31'240.56	0.03	a)
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	3'175	0	3'175	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1491231015	CATERPILLAR INC	863	346	748	461 USD	265.17	105'966.67	0.11	a)
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	402	129	57	474 USD	405.19	166'487.26	0.17	a)
US16411R2085	CHENIERE ENERGY INC	0	1'117	0	1'117 USD	161.86	156'724.42	0.16	a)
US1667641005	CHEVRON CORP	0	1'246	0	1'246 USD	163.66	176'768.36	0.18	a)
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	39	50	0	89 USD	1'962.28	151'389.22	0.15	a)
US1713401024	CHURCH & DWIGHT CO INC	1'281	0	1'281	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	5'389	0	810	4'579 USD	52.04	206'562.69	0.21	a)
US1729081059	CINTAS CORP	328	0	328	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US1912161007	COCA-COLA CO/THE	3'616	0	1'442	2'174 USD	61.93	116'709.06	0.12	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	3'452	2'524	272	5'704 USD	45.26	223'788.63	0.22	a)
US2058871029	CONAGRA BRANDS INC	0	2'500	2'500	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	1'949	0	1'949	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2091151041	CONSOLIDATED EDISON INC	2'001	204	359	1'846 USD	94.86	151'795.46	0.15	a)
US2166484020	COOPER COS INC/THE	0	74	74	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22052L1044	CORTEVA INC	3'086	0	3'086	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US22160N1090	COSTAR GROUP INC	0	716	0	716 USD	83.97	52'117.21	0.05	a)
US2310211063	CUMMINS INC	769	0	67	702 USD	260.80	158'704.28	0.16	a)
US23804L1035	DATADOG INC - CLASS A	0	299	299	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2441991054	DEERE & CO	266	0	21	245 USD	429.60	91'237.70	0.09	a)
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	0	1'783	1'783	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2521311074	DEXCOM INC	0	1'427	0	1'427 USD	124.56	154'080.09	0.15	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US2600031080	DOVER CORP	855	0	855	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26210C1045	DROPBOX INC-CLASS A	7'627	0	1'068	6'559 USD	26.95	153'228.78	0.15	a)
US26614N1028	DUPONT DE NEMOURS INC	537	0	537	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26875P1012	EOG RESOURCES INC	1'540	0	1'540	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US26884L1098	EQT CORP	0	1'909	1'909	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	1'585	2'270	3'855	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2788651006	ECOLAB INC	0	1'017	0	1'017 USD	183.14	161'453.74	0.16	a)
US28176E1082	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1'242	0	1'242	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US2855121099	ELECTRONIC ARTS INC	536	264	800	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3021301094	EXPEDITORS INTL WASH INC	0	249	249	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	2'458	161	2'619	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3024913036	FMC CORP	1'221	0	1'221	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US30303M1027	META PLATFORMS INC-CLASS A	0	226	0	226 USD	318.60	62'416.32	0.06	a)
US31620M1062	FIDELITY NATIONAL INFO SERV	490	0	490	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US34959E1091	FORTINET INC	709	474	0	1'183 USD	77.72	79'700.58	0.08	a)
US34959J1088	FORTIVE CORP	1'247	0	0	1'247 USD	78.35	84'693.37	0.08	a)
US35137L1052	FOX CORP - CLASS A	0	5'217	0	5'217 USD	33.45	151'272.82	0.15	a)
US36266G1076	GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	0	366	366	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3666511072	GARTNER INC	440	0	27	413 USD	353.59	126'588.42	0.13	a)
US3696043013	GENERAL ELECTRIC CO	0	1'352	1'352	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US3703341046	GENERAL MILLS INC	2'539	0	311	2'228 USD	74.74	144'348.49	0.14	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	2'632	254	200	2'686 USD	76.14	177'281.26	0.18	a)
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	2'200	0	136	2'064 USD	77.09	137'927.76	0.14	a)
US3848021040	VW GRAINGER INC	0	79	0	79 USD	738.49	50'572.64	0.05	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	787	0	154	633 USD	272.81	149'695.23	0.15	a)
US4165151048	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	830	0	830	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4180561072	HASBRO INC	2'808	0	1'914	894 USD	64.56	50'031.67	0.05	a)
US4364401012	HOLOGIC INC	0	1'983	1'983	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4404521001	HORMEL FOODS CORP	0	719	719	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4448591028	HUMANA INC	149	0	149	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45167R1041	IDEX CORP	143	0	143	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US45337C1027	INCYTE CORP	0	2'723	0	2'723 USD	63.72	150'406.76	0.15	a)
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	628	0	628	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4601461035	INTERNATIONAL PAPER CO	0	1'735	1'735	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4606901001	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	2'143	0	2'143	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US46120E6023	INTUITIVE SURGICAL INC	0	161	0	161 USD	324.40	45'274.19	0.05	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	0	280	143	137 USD	157.96	18'759.08	0.02	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	1'095	0	1'095	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US4824801009	KLA CORP	183	0	183	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1'051	0	1'051	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5010441013	KROGER CO	1'182	934	2'116	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5018892084	LKQ CORP	2'996	0	2'996	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5324571083	ELI LILLY & CO	415	307	66	656 USD	454.55	258'481.49	0.26	a)
US5341871094	LINCOLN NATIONAL CORP	2'294	2'029	4'323	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5502411037	LUMEN TECHNOLOGIES INC	24'728	0	24'728	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US5658491064	MARATHON OIL CORP	0	4'219	0	4'219 USD	26.27	96'075.70	0.10	a)
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP	0	2'633	1'125	1'508 USD	133.02	173'885.05	0.17	a)
US57636Q1040	MASTERCARD INC - A	316	0	0	316 USD	394.28	108'002.99	0.11	a)
US5801351017	MCDONALD'S CORP	239	0	239	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	2'319	287	144	2'462 USD	106.65	227'610.80	0.23	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	2'299	65	382	1'982 USD	335.92	577'143.04	0.57	a)
US60770K1079	MODERNA INC	874	0	874	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US60871R2094	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	0	1'865	0	1'865 USD	69.77	112'795.43	0.11	a)
US6174464486	MORGAN STANLEY	0	385	385	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US67066G1040	NVIDIA CORP	170	582	0	752 USD	467.29	304'612.89	0.30	a)
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	1'706	0	1'706	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US68389X1054	ORACLE CORP	467	0	467	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US6907421019	OWENS CORNING	0	1'288	0	1'288 USD	139.99	156'299.23	0.16	a)
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	0	1'362	0	1'362 USD	136.89	161'619.14	0.16	a)
US6935061076	PPG INDUSTRIES INC	0	1'278	0	1'278 USD	143.90	159'417.36	0.16	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	0	510	0	510 USD	249.96	110'505.69	0.11	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	0	2'560	1'913	647 USD	75.82	42'523.79	0.04	a)
US7170811035	PFIZER INC	4'404	0	4'404	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US71880K1016	PHINIA INC	0	662	662	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US72352L1061	PINTEREST INC- CLASS A	5'253	0	5'253	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	1'429	637	79	1'987 USD	156.30	269'215.96	0.27	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	666	0	0	666 USD	84.39	48'720.21	0.05	a)
US75886F1075	REGENERON PHARMACEUTICALS	61	178	0	239 USD	741.91	153'706.80	0.15	a)
US7591EP1005	REGIONS FINANCIAL CORP	1'226	594	1'820	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US7595091023	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	0	422	0	422 USD	292.86	107'131.32	0.11	a)
US81762P1021	SERVICENOW INC	0	379	0	379 USD	583.00	191'536.58	0.19	a)
US82968B1035	SIRIUS XM HOLDINGS INC	0	10'376	10'376	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8330341012	SNAP-ON INC	115	0	0	115 USD	272.44	27'158.93	0.03	a)
US8716071076	SYNOPSIS INC	557	0	102	455 USD	451.80	178'197.49	0.18	a)
US87165B1035	SYNCHRONY FINANCIAL	1'008	299	1'307	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8725901040	T-MOBILE US INC	412	0	412	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US88160R1014	TESLA INC	680	196	547	329 USD	267.43	76'269.34	0.08	a)
US88579Y1010	3M CO	1'782	173	1'955	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	414	0	414	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US90353T1007	UBER TECHNOLOGIES INC	0	3'846	0	3'846 USD	49.46	164'894.95	0.16	a)
US90384S3031	ULTA BEAUTY INC	73	67	0	140 USD	444.80	53'980.48	0.05	a)
US9113631090	UNITED RENTALS INC	437	119	130	426 USD	464.68	171'596.15	0.17	a)
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	683	0	641	42 USD	506.37	18'435.77	0.02	a)
US9182041080	VF CORP	0	4'167	4'167	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	0	1'298	0	1'298 USD	128.91	145'045.83	0.14	a)
US92343E1029	VERISIGN INC	341	0	0	341 USD	210.95	62'355.94	0.06	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3'453	0	3'453	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	245	329	0	574 USD	352.34	175'314.48	0.17	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	1'258	0	77	1'181 USD	237.73	243'376.05	0.24	a)
US9633201069	WHIRLPOOL CORP	0	211	211	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98138H1014	WORKDAY INC-CLASS A	0	800	0	800 USD	237.13	164'444.91	0.16	a)
US98419M1009	XYLEM INC	933	684	0	1'617 USD	112.75	158'041.27	0.16	a)
US9884981013	YUM! BRANDS INC	860	0	0	860 USD	137.67	102'631.75	0.10	a)
US9892071054	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	234	0	234	0 USD	0.00	0.00	0.00	
US98954M2008	ZILLOW GROUP INC - C	0	3'472	0	3'472 USD	54.16	163'005.53	0.16	a)
<b>US</b>							<b>12'947'633.35</b>	<b>12.89</b>	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>							<b>34'919'965.00</b>	<b>34.77</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	500	0	0	500 CHF	113.48%	567'400.00	0.56	a)
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	200	0	0	200 CHF	123.05%	246'100.00	0.25	a)
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	700	0	0	700 CHF	107.55%	752'850.00	0.75	a)
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	1'000	0	0	1'000 CHF	101.60%	1'016'000.00	1.01	a)
CH0024484187	2.5500 % ZURCTY 2.55 03/10/36	500	0	0	500 CHF	109.85%	549'250.00	0.55	a)
CH0024522747	2.6250 % BIENNE 2 5/8 03/03/26	600	0	0	600 CHF	101.75%	610'500.00	0.61	a)
CH0025826949	3.2500 % RESFER 3 1/4 06/30/32 EMTN	700	0	0	700 CHF	111.85%	782'950.00	0.78	a)
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	500	0	0	500 CHF	117.40%	587'000.00	0.58	a)
CH0115967397	2.2500 % PSHYPO 2 1/4 08/13/32 519	1'000	0	0	1'000 CHF	103.85%	1'038'500.00	1.03	a)
CH0116712644	2.0000 % RAIFFS 2 09/21/23	400	0	100	300 CHF	99.99%	299'970.00	0.30	a)
CH0119468368	2.1250 % TESSIN 2 1/8 11/24/34	1'000	0	0	1'000 CHF	104.00%	1'040'000.00	1.04	a)
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	400	0	0	400 CHF	103.01%	412'040.00	0.41	a)
CH0131610740	2.2500 % PFZENT 2 1/4 06/16/23 411	200	0	200	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0185577837	1.4500 % KBFRIB 1.45 06/07/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.00%	980'000.00	0.98	a)
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.15%	981'500.00	0.98	a)
CH0194695117	1.0000 % BERN 1 10/25/24	1'000	0	0	1'000 CHF	99.08%	990'800.00	0.99	a)
CH0199347680	1.5000 % ZUGKAN 1 1/2 11/20/37	1'000	0	0	1'000 CHF	94.65%	946'500.00	0.94	a)
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	1'000	0	0	1'000 CHF	97.15%	971'500.00	0.97	a)
CH0199773232	1.1250 % SOLEUR 1 1/8 11/29/27	1'000	0	0	1'000 CHF	98.30%	983'000.00	0.98	a)
CH0214925874	1.5000 % KTBL 1 1/2 06/26/28	1'000	0	0	1'000 CHF	99.60%	996'000.00	0.99	a)
CH0217579777	1.3750 % EGW 1 3/8 07/24/23 46	500	0	500	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0262085076	0.8750 % KBAARG 0 7/8 01/23/30	1'500	0	500	1'000 CHF	93.85%	938'500.00	0.93	a)
CH0273485380	0.3750 % PFZENT 0 3/8 02/14/25 461	1'500	0	500	1'000 CHF	97.90%	979'000.00	0.97	a)
CH0274314787	0.7500 % KBBL 0 3/4 03/30/28	1'000	0	0	1'000 CHF	95.05%	950'500.00	0.95	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CH0282528899	0.8750 % PSHYPO 0 7/8 06/25/37 611	1'000	0	0	1'000 CHF	89.35%	893'500.00	0.89	a)
CH0286138877	0.7500 % KBBERN 0 3/4 07/14/25	1'000	0	0	1'000 CHF	97.55%	975'500.00	0.97	a)
CH0291625231	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 01/26/26 616	1'500	0	500	1'000 CHF	96.47%	964'700.00	0.96	a)
CH0300874267	0.1250 % PFZENT 0 1/8 07/17/24 470	1'000	0	0	1'000 CHF	98.35%	983'500.00	0.98	a)
CH0302424392	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 06/15/29 621	200	0	0	200 CHF	92.92%	185'840.00	0.19	a)
CH0336352767	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 06/15/46 637	200	0	0	200 CHF	74.68%	149'360.00	0.15	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	900	0	0	900 CHF	92.56%	833'040.00	0.83	a)
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	800	0	0	800 CHF	98.12%	784'960.00	0.78	a)
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	1'000	0	0	1'000 CHF	72.55%	725'500.00	0.72	a)
CH0482172373	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 12/10/30 673	1'000	0	0	1'000 CHF	89.02%	890'200.00	0.89	a)
CH0485252800	0.0000 % PSHYPO 0 06/15/27 675	200	0	0	200 CHF	93.27%	186'540.00	0.19	a)
CH0506071270	0.1400 % KBFRIB 0.14 06/12/30	200	0	0	200 CHF	89.95%	179'900.00	0.18	a)
CH0522159034	1.7000 % KBBL 1.7 05/13/42	500	0	0	500 CHF	96.90%	484'500.00	0.48	a)
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	200	0	0	200 CHF	97.75%	195'500.00	0.19	a)
CH0525158413	0.0000 % PSHYPO 0 05/10/45 684	200	0	0	200 CHF	68.69%	137'380.00	0.14	a)
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	600	0	0	600 CHF	86.45%	518'700.00	0.52	a)
CH0569237669	0.2000 % GENEVA 0.2 09/28/35	800	0	0	800 CHF	83.70%	669'600.00	0.67	a)
CH0589031035	0.0000 % PFZENT 0 02/15/36 531	500	0	0	500 CHF	80.50%	402'500.00	0.40	a)
CH1100259758	0.1250 % PSHYPO 0 1/8 03/19/31 700	400	0	0	400 CHF	88.55%	354'200.00	0.35	a)
CH1101096522	0.0000 % PFZENT 0 03/13/28 534	700	0	0	700 CHF	92.25%	645'750.00	0.64	a)
CH1111392861	0.1000 % WKBNWS 0.1 04/18/31	400	0	0	400 CHF	87.00%	348'000.00	0.35	a)
CH1113135151	0.1250 % THURBK 0 1/8 05/21/32	900	0	0	900 CHF	85.70%	771'300.00	0.77	a)
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	1'000	0	230	770 CHF	86.45%	665'665.00	0.66	a)
CH1118223481	0.0500 % KSSTGA 0.05 09/30/31	600	0	0	600 CHF	83.80%	502'800.00	0.50	a)
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	200	0	0	200 CHF	92.45%	184'900.00	0.18	a)
CH1170565795	1.1000 % PFZENT 1.1 04/18/28 550	600	0	0	600 CHF	97.00%	582'000.00	0.58	a)
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	400	0	0	400 CHF	95.00%	380'000.00	0.38	a)
CH1174335807	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 04/08/52 717	400	0	0	400 CHF	89.00%	356'000.00	0.35	a)
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	200	0	0	200 CHF	96.75%	193'500.00	0.19	a)
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	500	0	0	500 CHF	94.90%	474'500.00	0.47	a)
CH1179534966	1.7000 % GRANDX 1.7 07/12/29	400	0	0	400 CHF	97.65%	390'600.00	0.39	a)
CH1179535021	1.6250 % PSHYPO 1 5/8 05/03/38 719	200	0	0	200 CHF	98.51%	197'020.00	0.20	a)
CH1189217826	1.5000 % PFZENT 1 1/2 12/17/29 553	100	0	100	0 CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH1209697551	1.2500 % THURBK 1 1/4 08/29/29	400	0	0	400 CHF	96.30%	385'200.00	0.38	a)
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	0	500	0	500 CHF	100.15%	500'750.00	0.50	a)
CH1239464741	2.1000 % PFZENT 2.1 04/27/35 573	0	200	0	200 CHF	103.60%	207'200.00	0.21	a)
<b>CHF</b>							<b>34'919'965.00</b>	<b>34.77</b>	
<b>Bezugsrechte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
GB00BMX3XT91	SHELL PLC-EEE FEB23	0	4'384	4'384	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BMX3XV14	SHELL PLC-EEE MAY23	0	4'113	4'113	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
NL0015001CV9	WOLTERS KLUWER NV	0	998	998	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
<b>Diverse</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

#### Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

							28'382'989.67	28.26	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>28'382'989.67</b>	<b>28.26</b>	
CH0030098732	SWC (CH) BF RESPONSIBLE GLOBAL RATES NT CHF	0	427	84	343 CHF	1'154.41	395'963.25	0.39	a)
CH0117045192	SWC (CH) INDEX BF USA GOVT. NT USD	0	5'000	0	5'000 USD	110.47	478'818.47	0.48	a)
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	22'095	0	0	22'095 USD	124.68	2'388'017.69	2.38	a)
CH0192251772	SWC (CH) EF RESP SMC SWITZERLAND (I) NT CHF	17'430	223	741	16'912 CHF	228.38	3'862'330.29	3.85	a)
CH0215804458	SWC (CH) INDEX BF UK GOVT. NT GBP	0	1'958	0	1'958 GBP	95.02	207'501.67	0.21	a)
CH0394628066	SWC (CH) MMF RESPONSIBLE OPPS CHF NT CHF	0	15'682	854	14'828 CHF	95.57	1'417'209.08	1.41	a)
CH0492410698	SWC (CH) BF RESPONSIBLE GLOBAL RATES NTH1 CHF	46'874	0	0	46'874 CHF	85.28	3'997'217.85	3.98	a)
CH0559828105	SWC (CH) BF RESPONS. GLBL AGGRT (EX CHF) NTH1 CHF	103'379	0	0	103'379 CHF	85.75	8'864'873.30	8.83	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	45'073	10'841	0	55'914 CHF	91.49	5'115'778.74	5.09	a)
CH0595708501	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NTH1 CHF	14'741	0	0	14'741 CHF	85.85	1'265'578.24	1.26	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.02.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 31.07.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>CH</b>							<b>27'993'288.58</b>	<b>27.87</b>	
0U1637934826	SWC (LU) MMF RESPONSIBLE USD NT	4'000	0	4'000	0 USD	0.00	0.00	0.00	
LU1637934826	SWC (LU) MMF RESPONSIBLE USD NT	0	4'000	0	4'000 USD	112.39	389'701.09	0.39	a)
<b>LU</b>							<b>389'701.09</b>	<b>0.39</b>	

#### Derivative Finanzinstrumente

**0.00 0.00**

#### Futures

**0.00 0.00**

03/23	AUST 10Y BOND FUT MAR23	0	14	14	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	SPI 200 FUTURES MAR23	6	0	6	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/23	EURO STOXX 50 MAR23	22	0	22	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/23	SWISS MKT IX FUTR MAR23	-10	10	0	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
03/23	S&P500 EMINI FUT MAR23	5	0	5	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/23	FTSE 100 IDX FUT MAR23	10	0	10	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	AUST 10Y BOND FUT JUN23	0	14	14	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	0	15	15	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	SWISS MKT IX FUTR JUN23	0	14	14	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	0	13	13	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	NASDAQ 100 E-MINI JUN23	0	2	2	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SWISS MKT IX FUTR SEP23	0	0	3	-3 CHF	0.00	0.00	0.00	a)
09/23	NASDAQ 100 E-MINI SEP23	0	2	0	2 USD	0.00	0.00	0.00	a)

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'506'503.11	1.50
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	34'839'297.42	34.69
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	34'919'965.00	34.77
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	28'382'989.67	28.26
Sonstige Vermögenswerte	788'318.09	0.78
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>100'437'073.29</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-89'855.81	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>100'347'217.48</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	98'142'252.09	97.72
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

#### Ausgeliehene Effekten

**9'477'243.29 9.44**

#### Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte

**4'700'122.79 4.68**

CH0010645932	GIVAUDAN-REG	131	CHF	2'939.00	385'009.00	0.38
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	579	CHF	552.80	320'071.20	0.32
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	210	CHF	493.40	103'614.00	0.10
FR0000120073	AIR LIQUIDE SA	165	EUR	163.36	25'761.50	0.03
FR0000120628	AXA SA	5'997	EUR	27.97	160'312.71	0.16
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	94	EUR	848.10	76'193.23	0.08
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1'142	EUR	162.04	176'860.07	0.18
US00724F1012	ADOBE INC	391	USD	546.17	185'117.96	0.18
US0231351067	AMAZON.COM INC	2'172	USD	133.68	251'692.46	0.25
US0378331005	APPLE INC	5'254	USD	196.45	894'717.75	0.89
US0533321024	AUTOZONE INC	21	USD	2'481.72	45'176.86	0.04
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	73	USD	2'970.80	187'992.37	0.19
US16119P1084	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	531	USD	405.19	186'507.88	0.19
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	234	USD	161.08	32'673.93	0.03
US5324571083	ELI LILLY & CO	506	USD	454.55	199'377.49	0.20
US58733R1023	MERCADOLIBRE INC	81	USD	1'238.05	86'929.50	0.09

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. Wäh- 31.07.2023 rung	Kurs (8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	2'338 USD	106.65	216'147.05	0.22	
US5949181045	MICROSOFT CORP	2'222 USD	335.92	647'029.18	0.64	
US8716071076	SYNOPSIS INC	455 USD	451.80	178'197.49	0.18	
US88160R1014	TESLA INC	420 USD	267.43	97'365.11	0.10	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	1'181 USD	237.73	243'376.05	0.24	
<b>Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte</b>				<b>4'777'120.50</b>	<b>4.76</b>	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	500 CHF	113.48%	567'400.00	0.56	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	200 CHF	123.05%	246'100.00	0.25	
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	500 CHF	117.40%	587'000.00	0.58	
CH0127181193	1.2500 % SWISS 1 1/4 06/27/37	305 CHF	103.01%	314'180.50	0.31	
CH0398633229	0.5000 % ZURNVX 0 1/2 12/18/24	200 CHF	98.12%	196'240.00	0.20	
CH0419041584	0.1000 % SGKNSW 0.1 10/10/41	100 CHF	72.55%	72'550.00	0.07	
CH0522159042	1.6000 % KBBL 1.6 05/13/32	200 CHF	97.75%	195'500.00	0.19	
CH0565650832	0.2500 % KBBL 0 1/4 09/02/32	500 CHF	86.45%	432'250.00	0.43	
CH1118223424	0.1000 % PFZENT 0.1 06/25/32 537	500 CHF	86.45%	432'250.00	0.43	
CH1170565662	0.9000 % PFZENT 0.9 05/20/33 548	200 CHF	92.45%	184'900.00	0.18	
CH1170565811	1.4500 % PFZENT 1.45 03/14/42 552	400 CHF	95.00%	380'000.00	0.38	
CH1179184390	0.8750 % BKWSW 0 7/8 04/27/26	200 CHF	96.75%	193'500.00	0.19	
CH1179184408	1.1250 % BKWSW 1 1/8 04/27/29	500 CHF	94.90%	474'500.00	0.47	
CH1217066583	1.8750 % KBBL 1 7/8 08/23/29	500 CHF	100.15%	500'750.00	0.50	

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

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.58412687
CAD	1 = CHF	0.65857550
DKK	100 = CHF	12.82455300
EUR	1 = CHF	0.95574372
GBP	1 = CHF	1.11533255
HKD	100 = CHF	11.11531400
JPY	100 = CHF	0.61011400
NOK	100 = CHF	8.56867500
SEK	100 = CHF	8.24982200
SGD	1 = CHF	0.65284681
USD	1 = CHF	0.86685000

## 4 Collateral ausgeliehene Effekten

Total der Collaterals pro Instrumentenklasse	Währung	Betrag	in %
ABS	CHF	4'815'800.15	47.793
Bond	CHF	5'171'536.30	51.324
Equity	CHF	26'522.52	0.263
Index bond	CHF	62'490.56	0.620
<b>Total</b>	<b>CHF</b>	<b>10'076'349.53</b>	<b>100.000</b>

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



## 5 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	546'358.22	0.544
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	339'277.50	0.338

## 6 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
BA CHF	CHF	-	-	-	-
DT CHF	CHF	-	-	-	-

## 7 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	4'700'122.79
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	4'777'120.50
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 8 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.02.2023 - 31.07.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
AA CHF	1.150	2.000	0.850	0.300	4.000
BA CHF	0.730	1.500	0.430	0.300	4.000
DT CHF	0.600	1.200	0.450	0.150	4.000

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

## 9 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 10 TER

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

## 11 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart.
- 23) Anpassung der Nachkommastellen von 2 auf 4 per 16.12.2021.
- 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.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-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 gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern 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 Konstanthaltung 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 aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabebewährung, 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 Bewertungs-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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Briefspannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen.

Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 1.8) näher definierten Periode.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach

Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Prospekt genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Betreffnisse 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 Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.