

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I - Balance

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

Jahresbericht per 30. September 2018

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen.....	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	28
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	28
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	28
Pauschale Verwaltungskommission	29
Benchmark.....	29
TER.....	29
Ausschüttung des Nettoertrags 2017 / 2018	29
Ausserordentliche Ausschüttung des Nettoertrags 2017 / 2018	30
Thesaurierung des Nettoertrags 2017 / 2018.....	30
Erklärung der Fussnoten	30
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	31
Bericht der Prüfgesellschaft.....	32

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 18.01.2019

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, Zürich

Fondsadministration

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND I - BALANCE

Übersicht	Rechnungsperiode bis	01.10.2017 30.09.2018	01.10.2016 30.09.2017	01.10.2015 30.09.2016	01.10.2014 30.09.2015
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		530'883'730.93	408'403'169.24	402'958'521.93	419'411'228.61
Klasse AA CHF 14)	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		512'509'626.24	408'403'169.24	402'958'521.93	419'411'228.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		355'453.049	282'138.264	288'175.000	305'928.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'441.85	1'447.53	1'398.31	1'370.95
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		1'441.85	-	-	-
Ausschüttung je Anteil		6.20	6.40	17.00	15.00
Ausserordentliche Ausschüttung je Anteil		3.20	-	22.20	-
Total Expense Ratio (synthetische TER)		1.38 %	1.50 %	1.49 %	1.44 %
Klasse CT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		18'374'104.69			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		185'445.141			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		99.08			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		99.08			
Thesaurierung je Anteil		1.01			
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.79 %			

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

Performance	YTD / 30.09.2018	2017	2016	2015
Klasse AA CHF	-2.35 %	8.25 %	1.80 %	-2.20 %
Klasse CT CHF (Lancierung 16.11.2017)	-1.92 %	1.13 %	-	-

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)	30.09.2018	30.09.2017
Bankguthaben auf Sicht	46'441'777.77	12'690'845.55
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	180'070'276.97	136'568'371.16
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	179'723'322.20	149'598'003.24
Strukturierte Produkte	17'410'645.46	8'159'682.40
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	78'332'489.56	91'152'035.51
Andere Anlagen - Metallkonten	26'806'599.57	7'950'742.49
Derivative Finanzinstrumente	15'435.91	322'614.29
Sonstige Vermögenswerte	2'668'079.67	2'404'207.39
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	531'468'627.11	408'846'502.03
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-7.79	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-584'888.39	-443'332.79
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	530'883'730.93	408'403'169.24

Entwicklung der Anzahl Anteile	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
Klasse AA CHF	bis	30.09.2018	30.09.2017
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		282'138.264	288'175.000
Ausgegebene Anteile		134'887.121	26'684.053
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		19'174.089	0.000
Zurückgenommene Anteile		-80'746.425	-32'720.789
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		355'453.049	282'138.264

Entwicklung der Anzahl Anteile	Rechnungsperiode	Lancierung 16.11.2017
Klasse CT CHF	bis	30.09.2018
Ausgegebene Anteile		193'813.966
Zurückgenommene Anteile		-8'368.825
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		185'445.141

Veränderung des Nettofondsvermögens (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
	bis	30.09.2018	30.09.2017
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		408'403'169.24	402'958'521.93
Ausbezahlte Ausschüttung		-2'885'958.40	-11'160'317.20
Saldo aus dem Anteilverkehr		125'370'997.06	-8'565'649.16
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		-4'476.97	25'170'613.67
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		530'883'730.93	408'403'169.24

Erfolgsrechnung (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
	bis	30.09.2018	30.09.2017
Ertrag			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-219'088.22	-17'149.70
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		3'865'583.79	3'253'047.39
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		3'169'309.65	2'936'753.62
Erträge der Gratisaktien		149'840.07	201'809.88
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'486'306.62	1'260'777.91
Erträge aus Wertpapierleihe		40'863.70	50'375.00
Erträge aus Rückvergütung		6'217.03	15.68
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds		-37'746.06	0.00
Sonstige Erträge		19'539.26	2'250.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		460'138.07	122'057.29
Total Ertrag		8'940'963.91	7'809'937.07
Aufwand			
Passivzinsen		-200.16	-186.05
Prüfaufwand		-589.77	-8'067.87
Reglementarische Vergütungen		-6'158'425.69	-5'117'817.08
Sonstige Aufwendungen		-23'206.14	-25'259.97
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-302'951.34	-155'303.93
Total Aufwand		-6'485'373.10	-5'306'634.90
Nettoertrag / Verlust		2'455'590.81	2'503'302.17
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		14'141'845.89	2'734'425.00
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		418'410.00	427'660.46
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP) 21)		98'385.52	0.00
Realisierter Erfolg		17'114'232.22	5'665'387.63
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-17'118'709.19	19'505'226.04
Gesamterfolg		-4'476.97	25'170'613.67

Verwendung des Erfolges	Klasse AA CHF	30.09.2018	30.09.2017
Nettoertrag		2'267'850.07	2'503'302.17
Vortrag des Vorjahres		729'270.48	31'653.20
Vortrag des Vorjahres aus übernommenen Fonds		142'064.87	0.00
Zwischenausschüttung		-902'946.07	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		2'236'239.35	2'534'955.37
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		2'203'808.91	1'805'684.89
Vortrag auf neue Rechnung		32'430.44	729'270.48
Total		2'236'239.35	2'534'955.37

Verwendung des Erfolges	Klasse CT CHF	30.09.2018
Nettoertrag		187'740.74
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		187'740.74
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		65'709.26
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		122'031.48
Total		187'740.74

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

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind								385'637'977.57	72.55	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								180'070'276.97	33.88	
AT0000743059	OMV AG	2'936	472	762	2'646	EUR	48.39	145'267.39	0.03	a)
AT0000938204	MAYR-MELNHOF KARTON AG	0	821	821	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
AT								145'267.39	0.03	
GB0000566504	BHP BILLITON PLC	8'253	15'995	0	24'248	GBP	1'671.20	516'183.66	0.10	a)
AU								516'183.66	0.10	
BE0003470755	SOLVAY SA	2'306	200	2'506	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003739530	UCB SA	1'310	7'267	1'468	7'109	EUR	77.40	624'269.55	0.12	a)
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	0	877	877	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003810273	PROXIMUS	6'799	851	7'650	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003826436	TELENET GROUP HOLDING NV	417	3'089	3'506	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974256852	COLRUYT SA	792	0	792	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974264930	AGEAS	0	599	599	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE								624'269.55	0.12	
BMG0692U1099	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	0	7'960	0	7'960	USD	57.71	448'714.18	0.08	a)
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	1'633	2'314	1'633	2'314	USD	228.47	516'414.21	0.10	a)
BMG5876H1051	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	25'128	4'539	29'667	0	USD	0.00	0.00	0.00	
BM								965'128.39	0.20	
CA01626P4033	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	0	6'849	552	6'297	CAD	64.61	307'450.31	0.06	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	23'972	0	23'972	CAD	20.55	372'269.62	0.07	a)
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	0	3'795	900	2'895	CAD	106.54	233'078.79	0.04	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	0	17'229	17'229	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0679011084	BARRICK GOLD CORP	0	12'889	12'889	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0977512007	BOMBARDIER INC-B	0	228'303	63'112	165'191	CAD	4.60	574'229.78	0.11	a)
CA1254911003	CI FINANCIAL CORP	0	29'503	29'503	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	0	1'578	1'578	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	0	1'194	1'194	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA15135U1093	CENOVUS ENERGY INC	0	12'911	0	12'911	CAD	12.97	126'543.94	0.02	a)
CA22576C1014	CRESCENT POINT ENERGY CORP	0	50'532	50'532	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA2918434077	EMPIRE CO LTD 'A'	0	30'864	1'908	28'956	CAD	23.54	515'094.04	0.10	a)
CA2925051047	ENCANA CORP	0	5'184	5'184	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	0	11'618	11'618	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3039011026	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0	415	415	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3180714048	FINNING INTERNATIONAL INC	0	24'113	1'075	23'038	CAD	31.55	549'269.69	0.10	a)
CA3809564097	GOLDCORP INC	0	2'430	2'430	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA39138C1068	GREAT-WEST LIFECO INC	0	24'277	0	24'277	CAD	31.34	574'957.19	0.11	a)
CA4480551031	HUSKY ENERGY INC	0	40'457	5'362	35'095	CAD	22.68	601'491.92	0.11	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	0	13'233	13'233	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4558711038	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	0	15'234	0	15'234	CAD	51.65	594'601.19	0.11	a)
CA47215Q1046	JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	0	28'199	28'199	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	115'783	115'783	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA53278L1076	LINAMAR CORP	0	6'023	593	5'430	CAD	59.51	244'191.91	0.05	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	2'175	0	2'175	CAD	66.36	109'070.46	0.02	a)
CA5592224011	MAGNA INTERNATIONAL INC	0	11'053	0	11'053	CAD	67.85	566'723.89	0.11	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	44'718	0	44'718	CAD	23.09	780'275.20	0.15	a)
CA59151K1084	METHANEX CORP	0	3'757	0	3'757	CAD	101.96	289'475.97	0.05	a)
CA68272K1030	ONEX CORPORATION	0	4'499	4'499	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	0	15'286	0	15'286	CAD	49.15	567'752.26	0.11	a)
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	8'794	8'794	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	0	26'496	0	26'496	CAD	28.06	561'835.89	0.11	a)
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	0	11'052	11'052	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	0	4'901	0	4'901	CAD	103.54	383'472.62	0.07	a)
CA78460T1057	SNC-LAVALIN GROUP INC	0	12'191	12'191	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA82028K2002	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	0	5'144	0	5'144	CAD	25.17	97'842.08	0.02	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	0	18'527	0	18'527	CAD	51.35	718'930.73	0.14	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	0	3'518	0	3'518	CAD	49.98	132'872.03	0.03	a)
CA8676EP1086	SUNOPTA INC	0	4'338	4'338	0	USD	0.00	0.00	0.00	
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	0	3'123	3'123	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	0	18'104	7'507	10'597	CAD	78.49	628'548.45	0.12	a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	0	6'157	0	6'157	CAD	73.51	342'024.39	0.06	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	0	6'943	0	6'943	CAD	97.77	512'972.73	0.10	a)
CA								10'384'975.08	1.99	
CH0000587979	SIKA AG-BR	0	37	37	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0001752309	FISCHER (GEORG)-REG	0	100	100	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002432174	BUCHER INDUSTRIES AG-REG	0	346	346	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0002497458	SGS SA-REG	0	52	52	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0006227612	VETROPACK HOLDING AG-BR	0	53	53	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	3'658	1'297	521	4'434	CHF	445.40	1'974'903.60	0.37	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0	1	1	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	661	165	113	713	CHF	2'413.00	1'720'469.00	0.32	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8'914	4'258	0	13'172	CHF	310.20	4'085'954.40	0.77	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	122'617	55'599	3'612	174'604	CHF	84.40	14'736'577.60	2.77	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	39'698	15'016	4'117	50'597	CHF	237.75	12'029'436.75	2.26	a)
CH0012032113	ROCHE HOLDING AG-BR	0	1'031	1'031	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	140'878	64'598	0	205'476	CHF	14.75	3'030'771.00	0.57	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	14'792	9'151	411	23'532	CHF	51.54	1'212'839.28	0.23	a)
CH0012214059	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	35'255	16'108	1'441	49'922	CHF	48.45	2'418'720.90	0.46	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	66'946	45'894	0	112'840	CHF	23.19	2'616'759.60	0.49	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2'004	2'603	0	4'607	CHF	390.30	1'798'112.10	0.34	a)
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	0	842	842	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3'528	1'627	308	4'847	CHF	372.00	1'803'084.00	0.34	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	0	371	371	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0038863350	NESTLE SA-REG	121'328	51'989	4'110	169'207	CHF	81.82	13'844'516.74	2.60	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	31'044	14'143	0	45'187	CHF	90.60	4'093'942.20	0.77	a)
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	13'715	3'935	1'106	16'544	GBP	2'613.00	550'655.30	0.10	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	25'876	10'275	273	35'878	CHF	80.00	2'870'240.00	0.54	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	176'957	84'981	0	261'938	CHF	15.50	4'060'039.00	0.76	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	29'078	11'399	33'733	6'744	EUR	15.67	119'897.25	0.02	a)
CH								72'966'918.72	13.72	
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	0	4'482	4'482	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005552004	DEUTSCHE POST AG-REG	10'101	4'630	14'731	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	11'509	35'350	0	46'859	EUR	13.89	738'178.82	0.14	a)
DE0005773303	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	590	0	590	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	6'953	1'178	8'131	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	0	883	883	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005937007	MAN SE	539	3'728	4'267	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006047004	HEIDELBERGCEMENT AG	1'169	916	2'085	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	874	874	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006062144	COVESTRO AG	5'714	1'471	1'035	6'150	EUR	69.86	487'445.84	0.09	a)
DE0006070006	HOCHTIEF AG	0	4'205	902	3'303	EUR	142.80	535'130.19	0.10	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	7'363	7'464	14'827	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006602006	GEA GROUP AG	0	3'586	3'586	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007037129	RWE AG	0	1'733	0	1'733	EUR	21.25	41'781.13	0.01	a)
DE0007100000	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	0	448	448	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	295	1'367	1'662	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	311	905	1'216	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007664005	VOLKSWAGEN AG	2'704	1'040	1'949	1'795	EUR	150.10	305'680.56	0.06	a)
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	3'517	308	1'508	2'317	EUR	151.60	398'517.97	0.07	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16'949	4'224	2'947	18'226	EUR	21.16	437'552.03	0.08	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	723	4'796	723	4'796	EUR	192.00	1'044'727.63	0.20	a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0	3'427	236	3'191	EUR	190.75	690'580.05	0.13	a)
DE000A13SX22	HELLA GMBH & CO KGAA	0	1'738	1'738	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000A1J5RX9	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	21'592	91'581	21'592	91'581	EUR	3.64	378'310.80	0.07	a)
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG -ORD	0	4'210	0	4'210	EUR	66.32	316'773.83	0.06	a)
DE000BASF111	BASF SE	593	572	1'165	0	EUR	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
DE000BAY0017	BAYER AG-REG	6'984	5'391	8'337	4'038	EUR	76.51	350'515.47	0.07	a)
DE000BFB0019	METRO AG	7'324	5'731	13'055	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	0	3'838	3'838	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	44'049	8'810	52'859	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	0	6'976	6'976	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000LED4000	OSRAM LICHT AG	0	1'399	1'399	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000SHA0159	SCHAEFFLER AG	24'773	17'280	2'303	39'750	EUR	11.01	496'531.87	0.09	a)
DE000TUAG000	TUI AG-DI	0	26'795	26'795	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
DE									6'221'726.19	1.17
ES0111845014	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	12'691	4'675	17'366	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	21'305	82'893	4'404	99'794	EUR	4.34	490'869.78	0.09	a)
ES0113902318	BANCO SANTANDER SA-INTERIM	0	150	150	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0124244E34	MAPFRE SA	82'169	9'021	91'190	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0140609019	CAIXABANK S.A	35'809	21'007	0	56'816	EUR	3.94	253'845.25	0.05	a)
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	78'092	15'823	31'599	62'316	EUR	6.34	448'099.52	0.08	a)
ES0144583178	IBERDROLA SA-INTERIM	0	1'262	1'262	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144583186	IBERDROLA SA-INTERIM	0	1'731	1'731	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173516115	REPSOL SA	28'960	7'080	1'545	34'495	EUR	17.17	671'773.14	0.13	a)
ES0173516131	REPSOL SA-INTERIM	0	793	793	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173516149	REPSOL SA-INTERIM	0	1'029	1'029	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0178430E18	TELEFONICA SA	9'244	0	9'244	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES									1'864'587.69	0.35
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	17'381	12'626	8'140	21'867	EUR	16.48	408'730.75	0.08	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	14'841	1'035	7'942	7'934	EUR	33.80	304'250.69	0.06	a)
FI									712'981.44	0.14
FR0000039299	BOLLORE	0	46'223	46'223	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	11'866	6'945	0	18'811	EUR	12.39	264'341.68	0.05	a)
FR0000120222	CNP ASSURANCES	18'523	6'077	1'190	23'410	EUR	20.76	551'380.55	0.10	a)
FR0000120271	TOTAL SA	8'263	6'281	1'559	12'985	EUR	55.84	822'640.41	0.15	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	10'652	2'538	971	12'219	EUR	37.23	516'120.82	0.10	a)
FR0000120578	SANOFI	3'795	1'219	4'114	900	EUR	76.56	78'174.86	0.01	a)
FR0000120628	AXA SA	0	4'228	4'228	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120685	NATIXIS	56'845	21'379	78'224	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	0	141	141	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121261	MICHELIN (CGDE)	0	2'552	0	2'552	EUR	102.95	298'077.84	0.06	a)
FR0000121501	PEUGEOT SA	20'795	26'735	24'875	22'655	EUR	23.23	597'084.71	0.11	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	20'387	4'240	1'907	22'720	EUR	17.19	443'105.23	0.08	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	9'614	2'081	11'695	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000125486	VINCI SA	0	5'342	0	5'342	EUR	82.02	497'102.93	0.09	a)
FR0000125585	CASINO GUICHARD PERRACHON	1'178	2'285	1'032	2'431	EUR	36.22	99'897.84	0.02	a)
FR0000130213	LAGARDERE SCA	13'629	4'089	17'718	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130452	EIFFAGE	0	6'479	1'312	5'167	EUR	96.16	563'709.81	0.11	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	855	0	855	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	10'608	2'010	12'618	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000133308	ORANGE	31'894	11'829	1'851	41'872	EUR	13.74	652'491.78	0.12	a)
FR0000184798	ORPEA	0	805	805	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010040865	GECINA SA	0	1'204	1'204	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010208488	ENGIE	14'459	17'255	0	31'714	EUR	12.67	455'699.86	0.09	a)
FR0010221234	EUTELSAT COMMUNICATIONS	16'319	12'238	19'049	9'508	EUR	20.36	219'628.97	0.04	a)
FR0010259150	IPSEN	0	3'089	3'089	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010411983	SCOR SE	10'692	9'345	8'362	11'675	EUR	40.00	529'833.67	0.10	a)
NL0000235190	AIRBUS SE	0	1'048	0	1'048	EUR	108.18	128'626.64	0.02	a)
FR									6'717'917.60	1.25

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
BMG475671050	IHS MARKIT LTD	0	0	0	0	USD	0.00	0.00	0.00	
ES0177542018	INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	11'396	7'071	3'049	15'418	EUR	7.40	129'479.14	0.02	a)
GB0000536739	ASHTAD GROUP PLC	0	19'685	0	19'685	GBP	2'437.00	611'069.83	0.11	a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	15'327	6'655	3'565	18'417	GBP	567.00	133'015.37	0.03	a)
GB0002162385	AVIVA PLC	0	107'629	7'966	99'663	GBP	489.50	621'421.89	0.12	a)
GB0002374006	DIAGEO PLC	1'804	1'298	3'102	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0002875804	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	6'401	486	6'887	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	0	53'539	37'553	15'986	GBP	636.40	129'589.51	0.02	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	157'587	12'031	143'737	25'881	GBP	669.80	220'813.74	0.04	a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	143'983	19'407	70'231	93'159	GBP	262.20	311'141.11	0.06	a)
GB0005758098	MEGGITT PLC	21'365	0	21'365	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0006043169	WM MORRISON SUPERMARKETS	144'455	20'701	67'800	97'356	GBP	259.40	321'686.31	0.06	a)
GB0006825383	PERSIMMON PLC	8'845	1'812	4'461	6'196	GBP	2'365.00	186'656.21	0.04	a)
GB0007099541	PRUDENTIAL PLC	0	26'530	26'530	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007188757	RIO TINTO PLC	15'384	1'128	16'512	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007980591	BP PLC	161'245	28'412	32'665	156'992	GBP	589.30	1'178'457.32	0.22	a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	174'642	112'951	287'593	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	25'165	23'004	9'425	38'744	GBP	171.80	84'786.65	0.02	a)
GB0008847096	TESCO PLC	187'713	60'884	92'248	156'349	GBP	239.80	477'577.85	0.09	a)
GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	6'994	13'150	7'059	13'085	GBP	1'536.80	256'148.00	0.05	a)
GB0009697037	BABCOCK INTL GROUP PLC	0	36'018	18'525	17'493	GBP	723.00	161'102.58	0.03	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	662	0	662	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0030646508	GKN PLC	94'593	7'584	102'177	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0030913577	BT GROUP PLC	98'858	281'428	264'094	116'192	GBP	225.30	333'455.07	0.06	a)
GB0031274896	MARKS & SPENCER GROUP PLC	35'520	18'668	0	54'188	GBP	288.80	199'342.63	0.04	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	0	105'380	0	105'380	GBP	171.78	230'584.80	0.04	a)
GB0033195214	KINGFISHER PLC	96'024	41'512	12'130	125'406	GBP	258.00	412'133.50	0.08	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	116'375	17'460	108'520	25'315	GBP	321.80	103'768.10	0.02	a)
GB00B01FLG62	G4S PLC	0	90'427	90'427	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	14'761	1'710	16'471	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	13'091	6'687	0	19'778	GBP	1'723.00	434'077.77	0.08	a)
GB00B5ZN1N88	SEGRO PLC	0	26'441	26'441	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B77J0862	OLD MUTUAL PLC	167'506	12'491	179'997	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B7KR2P84	EASYJET PLC	0	11'245	0	11'245	GBP	1'314.00	188'215.21	0.04	a)
GB00BD3VFW73	CONVATEC GROUP PLC	26'048	0	26'048	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11'177	7'414	13'229	5'362	EUR	39.15	238'153.75	0.04	a)
GB00BDVZY777	ROYAL MAIL PLC	78'765	15'469	64'167	30'067	GBP	477.10	182'725.61	0.03	a)
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	296'164	67'808	363'972	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKKMKR23	RSA INSURANCE GROUP PLC	0	35'701	35'701	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BVFD7Q58	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	6'454	0	6'454	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BY9D0Y18	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	94'040	39'081	133'121	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BZ1G4322	MELROSE INDUSTRIES PLC	0	131'417	0	131'417	GBP	199.90	334'629.51	0.06	a)
JE00B4T3BW64	GLENORE PLC	141'662	25'346	35'047	131'961	GBP	331.70	557'559.18	0.10	a)
JE00B783TY65	APTIV PLC	0	1'154	1'154	0	USD	0.00	0.00	0.00	
NL0006144495	RELX NV	15'652	4'059	19'711	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	0	20'145	0	20'145	EUR	10.35	236'554.00	0.04	a)
VGG607541015	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	0	935	0	935	USD	68.56	62'616.40	0.01	a)
GB									8'336'761.04	1.55
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	33'364	30'965	19'741	44'588	EUR	6.60	333'622.60	0.06	a)
IE00BGH1M568	PERRIGO CO PLC	0	4'404	4'404	0	USD	0.00	0.00	0.00	
IE									333'622.60	0.06
US83417M1045	SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	0	1'595	1'595	0	USD	0.00	0.00	0.00	
IL									0.00	0.00

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
IM00B5VQMV65	GVC HOLDINGS PLC	0	26'544	0	26'544	GBP	918.50	310'559.93	0.06	a)
IM								310'559.93	0.06	
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	34'135	135'518	169'653	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0000072626	INTESA SANPAOLO-RSP	103'494	17'457	120'951	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003128367	ENEL SPA	52'732	26'990	4'721	75'001	EUR	4.41	375'426.76	0.07	a)
IT0003132476	ENI SPA	35'048	14'650	14'360	35'338	EUR	16.28	652'788.35	0.12	a)
IT0003487029	UBI BANCA SPA	0	20'464	20'464	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	179'849	133'737	313'586	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003497176	TELECOM ITALIA-RSP	146'241	41'273	187'514	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0005239360	UNICREDIT SPA	0	1'710	1'710	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0005278236	PIRELLI & C SPA	0	34'596	0	34'596	EUR	7.23	283'704.82	0.05	a)
IT								1'311'919.93	0.24	
JP3040890000	JAPAN PRIME REALTY INVESTMEN	0	62	62	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3102000001	AISIN SEIKI CO LTD	5'900	2'800	8'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3111200006	ASAHI KASEI CORP	8'000	33'700	2'600	39'100	JPY	1'723.00	579'357.79	0.11	a)
JP3112000009	AGC INC	9'200	3'100	800	11'500	JPY	4'715.00	466'298.86	0.09	a)
JP3116000005	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	0	5'400	5'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3122800000	AMADA HOLDINGS CO LTD	6'300	7'000	13'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3126340003	ALFREDA HOLDINGS CORP	4'600	1'500	0	6'100	JPY	3'040.00	159'473.39	0.03	a)
JP3131090007	IIDA GROUP HOLDINGS CO LTD	0	21'300	21'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3134800006	IHI CORP	0	3'300	0	3'300	JPY	4'305.00	122'172.06	0.02	a)
JP3143600009	ITOCHU CORP	11'300	29'300	40'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164800009	NOK CORP	2'000	3'500	5'500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	5'800	4'900	5'800	4'900	JPY	4'839.00	203'909.06	0.04	a)
JP3165700000	NTT DATA CORP	0	50'500	3'000	47'500	JPY	1'573.00	642'550.33	0.12	a)
JP3174410005	OJI HOLDINGS CORP	0	99'000	11'000	88'000	JPY	825.00	624'340.40	0.12	a)
JP3190000004	OBAYASHI CORP	20'300	27'200	0	47'500	JPY	1'076.00	439'532.20	0.08	a)
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	0	11'300	11'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197800000	OMRON CORP	0	1'700	1'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	0	75'100	34'500	40'600	JPY	1'842.00	643'132.53	0.12	a)
JP3210200006	KAJIMA CORP	24'000	13'000	37'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3242800005	CANON INC	5'000	24'900	29'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3249600002	KYOCERA CORP	0	2'000	0	2'000	JPY	6'820.00	117'300.32	0.02	a)
JP3256000005	KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD	0	17'300	17'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3268950007	MEDIPAL HOLDINGS CORP	5'600	5'400	0	11'000	JPY	2'371.00	224'289.56	0.04	a)
JP3269600007	KURARAY CO LTD	22'600	4'200	26'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3270000007	KURITA WATER INDUSTRIES LTD	0	2'400	2'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3284600008	KOITO MANUFACTURING CO LTD	0	2'600	2'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3292200007	JTEKT CORP	2'300	7'500	9'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3293200006	COCA-COLA BOTTLERS JAPAN HOL	0	7'900	7'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3300600008	KONICA MINOLTA INC	0	21'400	0	21'400	JPY	1'208.00	222'313.34	0.04	a)
JP3336560002	SUNTORY BEVERAGE & FOOD LTD	0	2'400	2'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3351200005	SHIZUOKA BANK LTD/THE	0	51'000	51'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3358800005	SHIMIZU CORP	37'800	31'500	48'700	20'600	JPY	1'037.00	183'709.15	0.03	a)
JP3366800005	SHOWA SHELL SEKIYU KK	38'700	5'200	13'900	30'000	JPY	2'407.00	620'986.50	0.12	a)
JP3386030005	JFE HOLDINGS INC	0	24'600	0	24'600	JPY	2'607.00	551'519.60	0.10	a)
JP3386380004	J FRONT RETAILING CO LTD	0	5'400	5'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3386450005	JXTG HOLDINGS INC	70'500	32'700	14'100	89'100	JPY	858.30	657'660.31	0.12	a)
JP3388200002	AEON CO LTD	11'700	21'600	5'400	27'900	JPY	2'737.50	656'815.13	0.12	a)
JP3397200001	SUZUKI MOTOR CORP	9'400	2'200	11'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3398000004	SUZUKEN CO LTD	0	7'300	0	7'300	JPY	5'390.00	338'373.58	0.06	a)
JP3399400005	STANLEY ELECTRIC CO LTD	1'200	3'100	0	4'300	JPY	3'885.00	143'662.79	0.03	a)
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	0	14'000	0	14'000	JPY	665.00	80'063.49	0.02	a)
JP3404200002	SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES	11'000	17'800	28'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3404600003	SUMITOMO CORP	19'600	23'000	3'400	39'200	JPY	1'894.50	638'653.79	0.12	a)
JP3407400005	SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES	0	10'000	0	10'000	JPY	1'782.00	153'247.19	0.03	a)
JP3419050004	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	0	4'300	4'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	13'500	3'500	17'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3422950000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	0	16'400	0	16'400	JPY	5'060.00	713'639.99	0.13	a)
JP3429800000	ANA HOLDINGS INC	12'300	800	13'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
JP3435000009	SONY CORP	0	9'200	700	8'500	JPY	6'966.00	509'198.61	0.10	a)
JP3435350008	SONY FINANCIAL HOLDINGS INC	0	14'100	0	14'100	JPY	2'504.00	303'625.51	0.06	a)
JP3436100006	SOFTBANK GROUP CORP	0	4'200	900	3'300	JPY	11'470.00	325'508.38	0.06	a)
JP3443600006	TAISEI CORP	8'200	12'800	8'200	12'800	JPY	5'180.00	570'196.50	0.11	a)
JP3456000003	TAKASHIMAYA CO LTD	30'000	10'000	40'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3476480003	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	0	10'100	1'700	8'400	JPY	2'365.50	170'878.36	0.03	a)
JP3493800001	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	18'500	9'500	1'200	26'800	JPY	2'642.00	608'909.04	0.11	a)
JP3526600006	CHUBU ELECTRIC POWER CO INC	0	6'900	0	6'900	JPY	1'718.50	101'972.59	0.02	a)
JP3538800008	TDK CORP	0	1'900	0	1'900	JPY	12'390.00	202'446.24	0.04	a)
JP3539220008	T&D HOLDINGS INC	6'900	5'100	1'900	10'100	JPY	1'875.00	162'857.39	0.03	a)
JP3546800008	TERUMO CORP	0	1'400	1'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3551500006	DENSO CORP	8'300	4'000	12'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	0	900	900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	12'600	0	12'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3592200004	TOSHIBA CORP	0	46'000	46'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	4'194	16'300	0	20'494	JPY	7'095.00	1'250'443.14	0.24	a)
JP3634200004	TOYODA GOSEI CO LTD	0	6'800	0	6'800	JPY	2'805.00	164'031.25	0.03	a)
JP3651210001	NABTESCO CORP	0	5'709	5'709	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3657400002	NIKON CORP	14'000	6'700	20'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3672400003	NISSAN MOTOR CO LTD	4'900	0	4'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3678800008	HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CO	0	1'400	1'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3705200008	JAPAN AIRLINES CO LTD	0	14'700	0	14'700	JPY	4'084.00	516'283.07	0.10	a)
JP3729400006	NIPPON EXPRESS CO LTD	6'400	500	6'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3733000008	NEC CORP	0	14'300	0	14'300	JPY	3'140.00	386'145.08	0.07	a)
JP3733400000	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	11'700	1'800	13'500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	0	16'300	4'400	11'900	JPY	5'132.00	525'192.39	0.10	a)
JP3738600000	NGK SPARK PLUG CO LTD	0	1'800	0	1'800	JPY	3'310.00	51'237.19	0.01	a)
JP3752900005	JAPAN POST HOLDINGS CO LTD	0	11'300	11'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3753000003	NIPPON YUSEN KK	11'000	0	11'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3756600007	NINTENDO CO LTD	0	300	300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3758190007	NEXON CO LTD	0	46'000	46'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762600009	NOMURA HOLDINGS INC	0	9'200	9'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	0	23'400	23'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3778630008	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	0	15'200	0	15'200	JPY	4'415.00	577'110.68	0.11	a)
JP3785000005	HITACHI CHEMICAL CO LTD	0	8'100	8'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	0	75'600	63'000	12'600	JPY	3'860.00	418'256.47	0.08	a)
JP3802400006	FANUC CORP	0	1'400	1'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3802600001	FAMILYMART UNY HOLDINGS CO L	0	800	800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3805010000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	58'000	44'000	102'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3814000000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	0	15'500	0	15'500	JPY	5'115.00	681'808.09	0.13	a)
JP3814800003	SUBARU CORP	0	10'000	10'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3818000006	FUJITSU LTD	33'000	16'500	45'000	4'500	JPY	8'096.00	313'305.36	0.06	a)
JP3820000002	FUJI ELECTRIC CO LTD	18'000	73'200	76'000	15'200	JPY	4'550.00	594'757.33	0.11	a)
JP3830000000	BROTHER INDUSTRIES LTD	5'700	2'600	8'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	12'300	800	13'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	0	1'100	1'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3866800000	PANASONIC CORP	19'400	29'800	0	49'200	JPY	1'323.50	559'981.74	0.11	a)
JP3877600001	MARUBENI CORP	32'200	14'000	0	46'200	JPY	1'040.00	413'199.83	0.08	a)
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	13'800	2'600	14'800	1'600	JPY	3'794.00	52'203.80	0.01	a)
JP3893600001	MITSUMI & CO LTD	33'400	2'300	35'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3894900004	ISETAN MITSUKOSHI HOLDINGS L	0	46'500	0	46'500	JPY	1'395.00	557'842.99	0.10	a)
JP3896800004	MITSUBISHI GAS CHEMICAL CO	0	5'800	0	5'800	JPY	2'419.00	120'655.93	0.02	a)
JP3897700005	MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS	53'700	13'200	66'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3899800001	MITSUBISHI MOTORS CORP	6'300	29'600	0	35'900	JPY	802.00	247'601.71	0.05	a)
JP3902400005	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	15'800	6'000	21'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3902900004	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	114'100	54'900	169'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	0	14'600	2'200	12'400	JPY	5'637.00	601'110.81	0.11	a)
JP3935600001	YAMAZAKI BAKING CO LTD	24'100	30'600	25'800	28'900	JPY	2'274.00	565'162.22	0.11	a)
JP3939000000	YAMADA DENKI CO LTD	0	35'700	35'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	0	7'400	0	7'400	JPY	1'982.00	126'130.52	0.02	a)
JP3951600000	UNICHARM CORP	0	15'700	1'300	14'400	JPY	3'758.00	465'376.11	0.09	a)
JP3973400009	RICOH CO LTD	0	43'500	0	43'500	JPY	1'220.00	456'387.67	0.09	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
JP3982800009	ROHM CO LTD	2'700	1'300	4'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP									21'782'817.36	4.10
LU0061462528	RTL GROUP	3'971	1'320	5'291	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
LU0088087324	SES	0	15'737	0	15'737	EUR	18.90	337'447.66	0.06	a)
LU1598757687	ARCELORMITTAL	0	7'732	0	7'732	EUR	26.80	235'098.21	0.04	a)
LU									572'545.87	0.10
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	8'323	2'592	0	10'915	EUR	2'960.09	366'565.35	0.07	a)
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	52'941	7'690	28'021	32'610	GBP	2'636.50	1'095'162.26	0.21	a)
GB00B03MM408	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	0	1'672	0	1'672	GBP	2'689.00	57'269.97	0.01	a)
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	0	10'233	4'236	5'997	EUR	78.00	530'702.74	0.10	a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	9'192	7'467	16'659	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0000009355	UNILEVER NV-CVA	14'972	4'974	13'843	6'103	EUR	47.97	332'116.54	0.06	a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	0	9'189	0	9'189	EUR	45.98	479'357.91	0.09	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	1'336	446	1'782	0	USD	0.00	0.00	0.00	
NL0010773842	NN GROUP NV	0	9'849	9'849	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29'829	5'002	7'555	27'276	EUR	19.75	611'181.86	0.11	a)
NL									3'472'356.63	0.65
PTEDP0AM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	7'508	23'690	0	31'198	EUR	3.18	112'487.25	0.02	a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	3'697	0	3'697	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
PT									112'487.25	0.02
BMG169621056	BUNGE LTD	1'548	0	1'548	0	USD	0.00	0.00	0.00	
CA0717341071	BAUSCH HEALTH COS INC	0	12'473	0	12'473	CAD	33.17	312'649.62	0.06	a)
CA91911K1021	BAUSCH HEALTH COS INC	0	12'473	12'473	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
IE00B58JVZ52	SEAGATE TECHNOLOGY	0	5'651	0	5'651	USD	47.35	261'367.11	0.05	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	5'956	8'158	7'033	7'081	USD	86.73	599'887.19	0.11	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	1'164	0	1'164	0	USD	0.00	0.00	0.00	
NL0011031208	MYLAN NV	0	1'013	1'013	0	USD	0.00	0.00	0.00	
PA1436583006	CARNIVAL CORP	4'261	4'108	8'369	0	USD	0.00	0.00	0.00	
SG9999000020	FLEX LTD	0	3'298	3'298	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0010551028	AFLAC INC	3'796	17'551	8'151	13'196	USD	47.07	606'725.37	0.11	a)
US00130H1059	AES CORP	37'979	11'923	5'599	44'303	USD	14.00	605'852.39	0.11	a)
US00206R1023	AT&T INC	0	1'969	1'969	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	11'026	2'462	2'735	10'753	USD	73.36	770'538.99	0.14	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	3'358	2'259	5'617	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US00817Y1082	AETNA INC	3'176	230	3'406	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US00846U1016	AGILENT TECHNOLOGIES INC	0	884	884	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	7'567	0	7'567	USD	73.15	540'684.25	0.10	a)
US0126531013	ALBEMARLE CORP	0	839	839	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	5'194	703	5'897	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	295	540	494	341	USD	1'193.47	397'531.49	0.07	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	243	240	22	461	USD	1'207.08	543'553.92	0.10	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	193	398	25	566	USD	2'003.00	1'107'396.21	0.21	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	0	2'241	0	2'241	USD	106.49	233'107.55	0.04	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	3'813	462	4'275	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0304201033	AMERICAN WATER WORKS CO INC	0	1'103	1'103	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0326541051	ANALOG DEVICES INC	5'228	750	5'978	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0357104092	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35'726	2'504	38'230	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US03662Q1058	ANSYS INC	0	530	530	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ANTHEM INC	2'526	299	296	2'529	USD	274.05	676'993.17	0.13	a)
US0378331005	APPLE INC	11'084	1'121	6'025	6'180	USD	225.74	1'362'707.50	0.26	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	10'719	1'141	11'860	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	13'171	1'207	11'964	USD	50.27	587'477.10	0.11	a)
US03965L1008	ARCONIC INC	7'160	3'679	10'839	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US04685W1036	ATHENAHEALTH INC	0	357	357	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0527691069	AUTODESK INC	0	417	417	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0538071038	AVNET INC	0	4'098	0	4'098	USD	44.77	179'211.01	0.03	a)
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	31'237	36'526	67'763	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	7'485	1'448	941	7'992	USD	77.09	601'809.68	0.11	a)
US0758871091	BECTON DICKINSON AND CO	388	2'853	675	2'566	USD	261.00	654'188.36	0.12	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
US0846707026	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0	587	587	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	7'203	2'154	1'830	7'527	USD	79.36	583'484.37	0.11	a)
US09062X1037	BIOGEN INC	0	260	260	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US09247X1019	BLACKROCK INC	0	153	153	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0936711052	H&R BLOCK INC	9'999	1'097	11'096	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0970231058	BOEING CO/THE	2'609	427	463	2'573	USD	371.90	934'698.65	0.18	a)
US1091941005	BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT	0	1'460	1'460	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US10922N1037	BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	790	0	790	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	0	1'702	0	1'702	USD	131.95	219'368.67	0.04	a)
US12503M1080	CBOE GLOBAL MARKETS INC	4'223	287	4'510	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	0	11'870	0	11'870	USD	44.10	511'322.57	0.10	a)
US12514G1085	CDW CORP/DE	0	4'741	0	4'741	USD	88.92	411'789.30	0.08	a)
US1255091092	CIGNA CORP	2'605	282	2'887	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US1266501006	CVS HEALTH CORP	7'023	2'642	401	9'264	USD	78.72	712'343.20	0.13	a)
US12673P1057	CA INC	0	10'438	0	10'438	USD	44.15	450'146.27	0.08	a)
US1331311027	CAMDEN PROPERTY TRUST	0	1'258	1'258	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	0	6'467	0	6'467	USD	94.93	599'669.54	0.11	a)
US1510201049	CELGENE CORP	0	706	706	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US15135B1017	CENTENE CORP	2'541	2'737	1'108	4'170	USD	144.78	589'726.00	0.11	a)
US1567001060	CENTURYLINK INC	18'620	11'418	20'477	9'561	USD	21.20	197'990.72	0.04	a)
US1667641005	CHEVRON CORP	0	817	329	488	USD	122.28	58'288.23	0.01	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	21'230	4'580	5'667	20'143	USD	48.65	957'221.95	0.18	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	10'794	1'170	11'964	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	7'903	1'912	5'991	USD	77.15	451'482.48	0.08	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	19'168	5'099	24'267	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2003401070	COMERICA INC	0	3'603	3'603	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	0	7'837	0	7'837	USD	77.40	592'511.06	0.11	a)
US2193501051	CORNING INC	11'109	8'835	11'109	8'835	USD	35.30	304'639.99	0.06	a)
US23355L1061	DXC TECHNOLOGY CO	5'719	1'406	7'125	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	5'172	3'213	5'057	3'328	USD	111.19	361'455.38	0.07	a)
US24703L1035	DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	0	4'184	0	4'184	USD	97.12	396'922.76	0.07	a)
US2473617023	DELTA AIR LINES INC	6'090	2'790	8'880	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US25470F3029	DISCOVERY INC-C	0	24'767	4'917	19'850	USD	29.58	573'540.82	0.11	a)
US2566771059	DOLLAR GENERAL CORP	0	1'565	0	1'565	USD	109.30	167'086.04	0.03	a)
US26078J1007	DOWDUPONT INC	2'060	762	2'822	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2692464017	E*TRADE FINANCIAL CORP	0	3'703	3'703	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2774321002	EASTMAN CHEMICAL CO	0	1'196	1'196	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2786421030	EBAY INC	0	2'084	2'084	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2788651006	ECOLAB INC	0	701	701	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	0	8'605	0	8'605	USD	76.58	643'682.78	0.12	a)
US30161N1019	EXELON CORP	2'175	12'265	7'138	7'302	USD	43.66	311'409.04	0.06	a)
US30219G1085	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	4'832	2'560	435	6'957	USD	95.01	645'649.73	0.12	a)
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	1'349	0	758	591	USD	85.02	49'081.09	0.01	a)
US30303M1027	FACEBOOK INC-A	1'213	832	1'043	1'002	USD	164.46	160'965.82	0.03	a)
US3156161024	F5 NETWORKS INC	0	935	0	935	USD	199.42	182'131.88	0.03	a)
US31620R3030	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	0	14'854	0	14'854	USD	39.35	570'944.39	0.11	a)
US32008D1063	FIRST DATA CORP- CLASS A	0	8'121	0	8'121	USD	24.47	194'110.55	0.04	a)
US3377381088	FISERV INC	0	3'412	3'412	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US3379321074	FIRSTENERGY CORP	0	10'896	10'896	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US35671D8570	FREEDPORT-MCMORAN INC	3'559	1'660	5'219	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US3647601083	GAP INC/THE	15'190	2'117	8'536	8'771	USD	28.85	247'172.74	0.05	a)
US37045V1008	GENERAL MOTORS CO	0	4'104	0	4'104	USD	33.67	134'975.87	0.03	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	0	3'424	0	3'424	USD	77.21	258'233.72	0.05	a)
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	0	3'049	0	3'049	USD	83.39	248'357.37	0.05	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	0	5'017	3'000	2'017	USD	139.12	274'095.00	0.05	a)
US40414L1098	HCP INC	1'726	0	1'726	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US40434L1052	HP INC	24'710	14'571	20'372	18'909	USD	25.77	475'979.92	0.09	a)
US4052171000	HAIN CELESTIAL GROUP INC	0	2'484	2'484	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	0	6'876	0	6'876	USD	16.31	109'545.74	0.02	a)
US4361061082	HOLLYFRONTIER CORP	905	474	1'379	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	0	838	838	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	23'924	8'429	3'324	29'029	USD	21.10	598'301.62	0.11	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
US4448591028	HUMANA INC	0	122	122	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	17'760	9'750	1'759	25'751	USD	14.92	375'291.37	0.07	a)
US44919P5089	IAC/INTERACTIVECORP	0	2'731	2'731	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US45167R1041	IDEX CORP	0	400	400	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	16'579	3'474	20'053	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US46266C1053	IQVIA HOLDINGS INC	0	3'140	3'140	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	8'854	9'035	784	17'105	USD	34.52	576'765.82	0.11	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	885	813	781	917	USD	112.84	101'073.68	0.02	a)
US4698141078	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	0	6'259	0	6'259	USD	76.50	467'705.03	0.09	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	6'126	1'902	7'544	484	USD	138.17	65'322.80	0.01	a)
US48020Q1076	JONES LANG LASALLE INC	0	2'764	0	2'764	USD	144.32	389'645.99	0.07	a)
US4932671088	KEYCORP	8'471	0	8'471	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	0	8'358	0	8'358	USD	66.28	541'116.18	0.10	a)
US4990491049	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	0	14'597	14'597	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5002551043	KOHL'S CORP	4'095	7'771	5'658	6'208	USD	74.55	452'069.29	0.09	a)
US5010441013	KROGER CO	0	1'211	1'211	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	2'752	0	2'752	USD	173.68	466'878.52	0.09	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	2'830	931	3'761	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	0	8'030	8'030	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5218652049	LEAR CORP	0	4'197	1'488	2'709	USD	145.00	383'691.92	0.07	a)
US5253271028	LEIDOS HOLDINGS INC	7'553	1'467	9'020	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5272881047	LEUCADIA NATIONAL CORP	16'294	3'713	20'007	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5324571083	ELI LILLY & CO	0	680	680	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	0	1'118	1'118	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5745991068	MASCO CORP	0	1'268	1'268	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US58155Q1031	MCKESSON CORP	2'333	1'054	2'310	1'077	USD	132.65	139'549.60	0.03	a)
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	3'202	4'401	3'202	4'401	USD	70.94	304'963.74	0.06	a)
US59156R1086	METLIFE INC	4'686	5'657	5'232	5'111	USD	46.72	233'246.09	0.04	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	9'779	4'317	2'643	11'453	USD	114.37	1'279'490.40	0.24	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	3'442	4'544	7'986	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6153691059	MOODY'S CORP	0	1'250	1'250	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	0	11'644	0	11'644	USD	32.48	369'422.95	0.07	a)
US6200763075	MOTOROLA SOLUTIONS INC	0	5'467	767	4'700	USD	130.14	597'467.53	0.11	a)
US64110D1046	NETAPP INC	0	16'152	9'278	6'874	USD	85.89	576'710.40	0.11	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	32'475	8'202	40'677	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6558441084	NORFOLK SOUTHERN CORP	0	513	0	513	USD	180.50	90'448.26	0.02	a)
US6703461052	NUCOR CORP	512	0	512	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	0	14'056	0	14'056	USD	18.43	253'042.07	0.05	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	13'176	947	14'123	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	0	702	702	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6936561009	PVH CORP	347	1'782	2'129	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6937181088	PACCAR INC	5'900	2'405	2'523	5'782	USD	68.19	385'127.41	0.07	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	0	385	385	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7043261079	PAYCHEX INC	0	1'754	1'754	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	1'124	1'147	2'271	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7127041058	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	0	30'070	0	30'070	USD	17.12	502'855.08	0.09	a)
US7134481081	PEPSICO INC	2'853	250	3'103	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7153471005	PERSPECTA INC	0	2'803	2'803	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7170811035	PFIZER INC	16'452	9'426	2'581	23'297	USD	44.07	1'002'879.38	0.19	a)
US72651A2078	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	0	6'490	1'958	4'532	USD	24.53	108'590.82	0.02	a)
US7392761034	POWER INTEGRATIONS INC	0	611	611	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US74251V1026	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6'624	1'485	2'084	6'025	USD	58.59	344'815.04	0.06	a)
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	0	513	513	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7433151039	PROGRESSIVE CORP	10'031	1'742	2'334	9'439	USD	71.04	654'989.88	0.12	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	0	6'260	0	6'260	USD	101.32	619'548.29	0.12	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	0	2'515	2'515	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	4'794	6'078	5'603	5'269	USD	107.91	555'386.79	0.10	a)
US74876Y1010	QUINTILES IMS HOLDINGS INC	2'015	277	2'292	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7512121010	RALPH LAUREN CORP	0	1'443	0	1'443	USD	137.55	193'879.81	0.04	a)
US7593516047	REINSURANCE GROUP OF AMERICA	0	3'628	1'766	1'862	USD	144.56	262'925.96	0.05	a)
US7841171033	SEI INVESTMENTS COMPANY	0	6'184	6'184	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US78467J1007	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	0	9'161	0	9'161	USD	56.83	508'541.25	0.10	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
US78486Q1013	SVB FINANCIAL GROUP	0	676	676	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US79466L3024	SALESFORCE.COM INC	0	517	517	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8318652091	SMITH (A.O.) CORP	0	1'070	1'070	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US85207U1051	SPRINT CORP	0	24'809	0	24'809	USD	6.54	158'486.64	0.03	a)
US85208M1027	SPROUTS FARMERS MARKET INC	0	2'787	2'787	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8718291078	SYSCO CORP	9'074	1'159	2'023	8'210	USD	73.25	587'430.43	0.11	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	2'297	2'297	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8740541094	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	0	1'036	1'036	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US87612E1064	TARGET CORP	0	3'287	0	3'287	USD	88.21	283'219.52	0.05	a)
US8793691069	TELEFLEX INC	0	515	515	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8962391004	TRIMBLE INC	0	1'328	1'328	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US90130A2006	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	2'646	0	2'646	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9024941034	TYSON FOODS INC-CL A	4'298	2'197	6'495	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9029733048	US BANCORP	0	1'659	1'659	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	0	1'027	1'027	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	3'744	892	797	3'839	USD	266.04	997'632.76	0.19	a)
US9139031002	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2'785	707	3'492	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US91529Y1064	UNUM GROUP	0	3'406	3'406	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	0	3'407	0	3'407	USD	113.75	378'555.18	0.07	a)
US92276F1003	VENTAS INC	6'638	463	7'101	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US92339V1008	VEREIT INC	51'345	15'680	0	67'025	USD	7.26	475'312.35	0.09	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	0	6'837	6'837	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	0	557	557	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	4'125	531	3'435	1'221	USD	156.06	186'128.52	0.04	a)
US9290891004	VOYA FINANCIAL INC	0	12'301	976	11'325	USD	49.67	549'462.45	0.10	a)
US9311421039	WALMART INC	7'975	1'604	9'579	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9314271084	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	6'940	2'352	0	9'292	USD	72.90	661'671.43	0.12	a)
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	6'253	443	6'696	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	0	2'666	2'666	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9581021055	WESTERN DIGITAL CORP	4'866	1'300	6'166	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9598021098	WESTERN UNION CO	0	22'465	0	22'465	USD	19.06	418'249.06	0.08	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	7'419	1'398	0	8'817	USD	53.44	460'249.09	0.09	a)
US9633201069	WHIRLPOOL CORP	0	252	252	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9815581098	WORLDPAY INC-CLASS A	0	3'985	0	3'985	USD	101.27	394'198.34	0.07	a)
US9839191015	XILINX INC	0	689	689	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9841216081	XEROX CORP	8'931	1'010	9'941	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9897011071	ZIONS BANCORP NA	0	5'063	5'063	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US									42'574'043.29	8.01
GB00B17BBQ50	INVESTEC PLC	11'960	20'835	11'960	20'835	GBP	539.60	143'207.36	0.03	a)
ZA									143'207.36	0.03
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte									179'723'322.20	33.82
AU0000QBCHF5	6.5000 % Q 6 1/2 07/12/21 MTN	1'000	0	1'000	0	AUD	110.20%	0.00	0.00	
AU000XQLQAB5	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/28 28	0	1'500	1'500	0	AUD	100.71%	0.00	0.00	
AU3CB0216141	5.2500 % BNG 5 1/4 05/20/24 MTN	500	0	500	0	AUD	112.19%	0.00	0.00	
AU3CB0224046	4.7500 % MET 4 3/4 09/17/21 AMTN	0	100	0	100	AUD	104.83%	74'090.03	0.01	a)
AU3CB0236263	4.0000 % CS 4 03/09/21 MTN	500	100	0	600	AUD	102.59%	435'058.25	0.08	a)
AU3CB0239085	2.2500 % LBANK 2 1/4 02/17/21 MTN	1'000	100	1'100	0	AUD	99.45%	0.00	0.00	
AU3CB0242147	3.5000 % WSTP 3 1/2 02/07/22 MTN	1'000	100	1'100	0	AUD	101.78%	0.00	0.00	
AU3CB0244960	3.5000 % LHNXX 3 1/2 06/16/22 MTN	440	0	0	440	AUD	100.86%	313'637.96	0.06	a)
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	0	820	0	820	AUD	99.57%	577'065.73	0.11	a)
AU3FN0037495	3.1700 % VZ 0 02/17/23 MTN	0	60	0	60	AUD	100.41%	42'580.53	0.01	a)
AU3SG0001522	2.7500 % WATC 2 3/4 10/20/22 22	0	1'000	1'000	0	AUD	100.89%	0.00	0.00	
AU3SG0001639	2.5000 % WATC 2 1/2 07/23/24 24	0	2'000	2'000	0	AUD	98.45%	0.00	0.00	
XS1014094061	5.0000 % NAB 5 01/17/20 GMTN	0	100	0	100	AUD	103.09%	72'862.06	0.01	a)
XS1074107910	4.7500 % EIBKOR 4 3/4 06/03/21 EMTN	500	0	0	500	AUD	103.90%	367'177.71	0.07	a)
XS1094768469	4.2500 % CCLAU 4 1/4 08/12/21 EMTN	0	500	0	500	AUD	103.72%	366'517.33	0.07	a)
XS1602259985	3.5000 % CCLAU 3 1/2 04/26/24 EMTN	0	500	0	500	AUD	101.19%	357'572.36	0.07	a)
AUD									2'606'561.96	0.49

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
CA045167CR29	2.2500 % ASIA 2 1/4 09/16/21 GMTN	0	200	200	0	CAD	99.28%	0.00	0.00	
CA060505FG45	3.4070 % BAC 3.407 09/20/25 MPLE	0	1'000	0	1'000	CAD	98.67%	745'605.36	0.14	a)
CA13509PFC29	1.2500 % CANHOU 1 1/4 12/15/20	0	100	100	0	CAD	97.64%	0.00	0.00	
CA36158ZBV72	4.6000 % GE 4.6 01/26/22 MTN	700	0	0	700	CAD	104.35%	551'985.70	0.10	a)
CA40427HRV73	3.5580 % HSBC 3.558 10/04/17 DPNT	500	0	500	0	CAD	100.00%	0.00	0.00	
CA563469UJ24	2.5500 % MP 2.55 06/02/26	1'000	200	0	1'200	CAD	96.94%	879'047.45	0.17	a)
CA626209JG63	4.8750 % BCMFA 4 7/8 06/03/19	400	0	0	400	CAD	101.89%	307'987.47	0.06	a)
CA669827FV45	4.1500 % NS 4.15 11/25/19	500	0	500	0	CAD	102.21%	0.00	0.00	
CAD								2'484'625.98	0.47	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	3'000	180	3'180	0	CHF	137.66%	0.00	0.00	
CH0026791225	3.1250 % C 3 1/8 09/27/21 EMTN	1'500	100	0	1'600	CHF	109.05%	1'744'800.00	0.33	a)
CH0031226134	3.2500 % PSHYPO 3 1/4 06/15/27 424	0	125	0	125	CHF	124.59%	155'737.50	0.03	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	0	300	0	300	CHF	114.70%	344'100.00	0.06	a)
CH0103165020	3.0000 % ALPHSW 3 11/25/19	160	0	135	25	CHF	103.31%	25'827.50	0.00	a)
CH0109674470	2.6250 % AXPOSW 2 5/8 02/26/20	2'000	0	0	2'000	CHF	103.24%	2'064'800.00	0.39	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOSW 3 1/8 02/26/25	1'000	0	0	1'000	CHF	109.95%	1'099'500.00	0.21	a)
CH0112272783	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/12/20 111	5'000	0	5'000	0	CHF	103.75%	0.00	0.00	
CH0122456756	2.0000 % ZKB 2 01/21/21 117	1'000	0	1'000	0	CHF	105.60%	0.00	0.00	
CH0123575091	2.1250 % NRSKTO 2 1/8 02/14/20 EMTN	125	0	0	125	CHF	103.18%	128'975.00	0.02	a)
CH0124853604	2.6250 % SGSNVX 2 5/8 03/08/19	1'300	0	1'300	0	CHF	101.32%	0.00	0.00	
CH0127513114	3.1250 % ABNANV 3 1/8 04/27/21 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	108.20%	2'164'000.00	0.41	a)
CH0133090636	2.8750 % ZURNVX 2 7/8 07/27/21 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	108.20%	1'082'000.00	0.20	a)
CH0136940282	2.2500 % ALPHSW 2 1/4 09/20/21	2'000	0	0	2'000	CHF	104.25%	2'085'000.00	0.39	a)
CH0144279061	1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/15/21 417	1'000	0	1'000	0	CHF	105.43%	0.00	0.00	
CH0180513183	1.6250 % ROSW 1 5/8 09/23/22	1'400	0	0	1'400	CHF	106.60%	1'492'400.00	0.28	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	0	250	0	250	CHF	110.30%	275'750.00	0.05	a)
CH0185843023	2.6250 % GLENLN 2 5/8 12/03/18 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	100.48%	0.00	0.00	
CH0187218901	3.0000 % LHNVDX 3 11/22/22	0	200	0	200	CHF	109.90%	219'800.00	0.04	a)
CH0188098740	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 06/25/19 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	101.51%	0.00	0.00	
CH0188295312	3.5000 % CLNVX 3 1/2 09/26/22	1'000	0	0	1'000	CHF	111.61%	1'116'060.00	0.21	a)
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	1'100	200	0	1'300	CHF	107.25%	1'394'250.00	0.26	a)
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	1'000	0	0	1'000	CHF	105.84%	1'058'400.00	0.20	a)
CH0200044771	1.5000 % NANTDR 1 1/2 02/15/21	500	1'000	0	1'500	CHF	102.60%	1'539'000.00	0.29	a)
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	1'000	150	0	1'150	CHF	106.60%	1'225'900.00	0.23	a)
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	0	150	0	150	CHF	112.25%	168'375.00	0.03	a)
CH0204477241	2.2500 % BLDAU 2 1/4 02/20/20 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	102.10%	1'021'000.00	0.19	a)
CH0204567322	1.3750 % CAF 1 3/8 02/11/21 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	103.25%	1'032'500.00	0.19	a)
CH0204574914	2.1250 % NTGYSM 2 1/8 02/08/19 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	100.87%	0.00	0.00	
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	500	0	0	500	CHF	110.95%	554'750.00	0.10	a)
CH0208580693	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 03/28/23	1'000	0	1'000	0	CHF	105.30%	0.00	0.00	
CH0209474631	1.7500 % LONNVX 1 3/4 04/10/19	1'300	0	0	1'300	CHF	100.93%	1'312'090.00	0.25	a)
CH0212184052	1.0000 % RELLN 1 12/18/18	0	500	500	0	CHF	100.27%	0.00	0.00	
CH0214925825	1.0000 % ENAG 1 12/14/18	200	0	0	200	CHF	100.11%	200'220.00	0.04	a)
CH0215650737	2.0000 % SPSNSW 2 10/21/20	500	0	0	500	CHF	103.50%	517'500.00	0.10	a)
CH0222760826	1.3750 % KBSCHW 1 3/8 09/24/21	1'000	0	1'000	0	CHF	105.00%	0.00	0.00	
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	500	0	0	500	CHF	108.20%	541'000.00	0.10	a)
CH0225941605	1.2500 % PFZENT 1 1/4 10/29/21 440	1'000	0	0	1'000	CHF	104.81%	1'048'100.00	0.20	a)
CH0229751927	2.5000 % BANBRA 2 1/2 06/20/19 EMTN	0	300	0	300	CHF	101.10%	303'300.00	0.06	a)
CH0234274493	1.7500 % SPSNSW 1 3/4 04/16/21	500	0	0	500	CHF	103.45%	517'250.00	0.10	a)
CH0236122724	1.3750 % SGSNVX 1 3/8 02/25/22	1'037	0	0	1'037	CHF	104.35%	1'082'109.50	0.20	a)
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	2'000	0	0	2'000	CHF	99.45%	1'989'000.00	0.37	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	107.30%	1'609'500.00	0.30	a)
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449	1'000	0	0	1'000	CHF	105.58%	1'055'800.00	0.20	a)
CH0244830441	1.2500 % MIVIVI 1 1/4 06/13/18	800	0	800	0	CHF	100.00%	0.00	0.00	
CH0245865834	1.0000 % NAB 1 12/10/21 GMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	103.25%	2'065'000.00	0.39	a)
CH0246920208	1.1250 % KBLUZE 1 1/8 06/30/23	1'000	0	0	1'000	CHF	105.50%	1'055'000.00	0.20	a)
CH0248259456	0.7500 % CS 0 3/4 07/11/19	1'000	200	1'200	0	CHF	100.82%	0.00	0.00	
CH0254281634	1.0000 % ICBCAS 1 12/17/19	0	100	0	100	CHF	101.53%	101'530.00	0.02	a)
CH0255475276	0.0000 % LISNSW 0 10/06/17	500	0	500	0	CHF	100.00%	0.00	0.00	
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	0	200	0	200	CHF	104.90%	209'800.00	0.04	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	500	0	500	CHF	103.75%	518'750.00	0.10	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
01.10.2017					30.09.2018					
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	2'000	0	0	2'000	CHF	102.35%	2'047'000.00	0.39	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	98.25%	982'500.00	0.18	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	1'000	1'200	0	2'200	CHF	100.19%	2'204'180.00	0.41	a)
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	1'000	100	0	1'100	CHF	100.50%	1'105'500.00	0.21	a)
CH0273755824	0.2300 % SWIAL 2015-1 A	2'000	0	0	2'000	CHF	100.14%	2'002'780.00	0.38	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	96.10%	1'922'000.00	0.36	a)
CH0274758827	0.6250 % MDLZ 0 5/8 12/30/21	0	200	0	200	CHF	101.20%	202'400.00	0.04	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'000	200	0	2'200	CHF	101.15%	2'225'300.00	0.42	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'000	0	0	1'000	CHF	101.10%	1'011'000.00	0.19	a)
CH0276581110	0.1940 % CABEI 0.194 11/19/21 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.25%	1'002'500.00	0.19	a)
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	102.15%	2'043'000.00	0.38	a)
CH0278875940	0.6250 % FABUH 0 5/8 05/27/22	1'000	0	0	1'000	CHF	101.15%	1'011'500.00	0.19	a)
CH0278875965	0.2500 % BCICI 0 1/4 06/17/20	200	0	0	200	CHF	100.20%	200'400.00	0.04	a)
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	500	100	0	600	CHF	100.60%	603'600.00	0.11	a)
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	900	0	0	900	CHF	101.50%	913'500.00	0.17	a)
CH0282857926	0.3400 % SWICC 2015-2 A	2'000	2'000	2'000	2'000	CHF	100.35%	2'007'000.00	0.38	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	0	1'000	0	1'000	CHF	101.95%	1'019'500.00	0.19	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	1'000	0	0	1'000	CHF	101.95%	1'019'500.00	0.19	a)
CH0297782952	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/21/23	0	1'000	0	1'000	CHF	102.90%	1'029'000.00	0.19	a)
CH0304055806	0.2000 % SWICA 2015-1 A	1'000	0	0	1'000	CHF	100.03%	1'000'250.00	0.19	a)
CH0304749218	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 12/16/22	1'000	0	0	1'000	CHF	101.65%	1'016'500.00	0.19	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	0	1'000	CHF	102.60%	1'026'000.00	0.19	a)
CH0307256401	0.0300 % ZKB 0.03 02/11/22 137	1'000	0	0	1'000	CHF	100.80%	1'008'000.00	0.19	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'000	100	0	2'100	CHF	98.00%	2'058'000.00	0.39	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	1'000	0	0	1'000	CHF	100.85%	1'008'500.00	0.19	a)
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	0	200	0	200	CHF	99.60%	199'200.00	0.04	a)
CH0310451841	0.7500 % UBS 0 3/4 02/22/22	800	0	0	800	CHF	101.45%	811'600.00	0.15	a)
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	0	500	0	500	CHF	100.45%	502'250.00	0.09	a)
CH0311427626	0.3710 % CABEI 0.371 08/26/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	100.20%	1'002'000.00	0.19	a)
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	1'000	0	0	1'000	CHF	100.60%	1'006'000.00	0.19	a)
CH0319403082	0.1500 % SWICA 2016-1 A	500	0	500	0	CHF	98.85%	0.00	0.00	
CH0323440104	0.3000 % SWICA 2016-2 A	500	0	0	500	CHF	100.20%	501'000.00	0.09	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	400	0	0	400	CHF	99.55%	398'200.00	0.07	a)
CH0326371389	0.1300 % SWICC 2016-1 A	750	0	0	750	CHF	100.13%	750'945.00	0.14	a)
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	100.65%	503'250.00	0.09	a)
CH0328298028	0.2200 % SWIAL 2016-1 A	200	200	200	200	CHF	100.20%	200'400.00	0.04	a)
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	102.45%	512'250.00	0.10	a)
CH0333827472	0.1250 % TEVA 0 1/8 07/27/18	615	200	815	0	CHF	100.00%	0.00	0.00	
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	1'445	0	0	1'445	CHF	89.85%	1'298'332.50	0.24	a)
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	440	0	0	440	CHF	97.95%	430'980.00	0.08	a)
CH0340912150	0.0100 % SOONVX 0.01 10/11/21	1'000	100	0	1'100	CHF	99.80%	1'097'800.00	0.21	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	500	0	0	500	CHF	96.55%	482'750.00	0.09	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	0	1'000	0	1'000	CHF	99.02%	990'200.00	0.19	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	200	0	200	CHF	98.65%	197'300.00	0.04	a)
CH0357483210	0.1400 % SWMOB 2017-1 A	1'000	0	0	1'000	CHF	100.01%	1'000'100.00	0.19	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	97.60%	976'000.00	0.18	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	1'000	200	0	1'200	CHF	98.96%	1'187'520.00	0.22	a)
CH0358181219	0.7500 % DB 0 3/4 03/21/22 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.25%	992'500.00	0.19	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	200	0	200	CHF	97.20%	194'400.00	0.04	a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	0	100	0	100	CHF	99.35%	99'350.00	0.02	a)
CH0360172727	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	98.00%	980'000.00	0.18	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	0	1'000	0	1'000	CHF	98.67%	986'700.00	0.19	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	1'000	0	0	1'000	CHF	98.70%	987'000.00	0.19	a)
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP ..	500	0	0	500	CHF	101.05%	505'250.00	0.10	a)
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	1'000	200	0	1'200	CHF	100.50%	1'206'000.00	0.23	a)
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	1'000	200	0	1'200	CHF	99.35%	1'192'200.00	0.22	a)
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	1'500	300	0	1'800	CHF	100.00%	1'800'000.00	0.34	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	97.40%	1'461'000.00	0.27	a)
CH0370943620	0.2000 % FCACCH 0.2 07/24/20	700	0	0	700	CHF	99.95%	699'650.00	0.13	a)
CH0373476032	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 12/08/25 0	0	1'000	0	1'000	CHF	97.45%	974'500.00	0.18	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	0	500	0	500	CHF	98.20%	491'000.00	0.09	a)
CH0373476594	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 MAR	0	1'000	1'000	0	CHF	98.62%	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
01.10.2017					30.09.2018					
CH0373476677	0.2500 % ZKB 0 1/4 05/08/25 143	0	1'000	0	1'000	CHF	100.55%	1'005'500.00	0.19	a)
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	98.35%	983'500.00	0.19	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	0	2'000	0	2'000	CHF	98.70%	1'974'000.00	0.37	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	97.20%	972'000.00	0.18	a)
CH0380360062	0.4500 % GLJGR 0.45 09/15/20	500	0	0	500	CHF	99.85%	499'250.00	0.09	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	97.80%	978'000.00	0.18	a)
CH0398633369	0.3500 % BQNCHT 0.35 09/14/26	0	1'000	0	1'000	CHF	99.15%	991'500.00	0.19	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	0	1'500	0	1'500	CHF	99.65%	1'494'750.00	0.28	a)
CH0398633443	0.5500 % UNIZUE 0.55 09/28/28	0	1'000	0	1'000	CHF	99.40%	994'000.00	0.19	a)
CH0398633526	0.7500 % SGSNVX 0 3/4 10/29/25	0	1'900	0	1'900	CHF	100.24%	1'904'560.00	0.36	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.25%	992'500.00	0.19	a)
CH0398677754	2.8750 % CREAL 2 7/8 02/09/22	0	1'000	0	1'000	CHF	99.00%	990'000.00	0.19	a)
CH0401673980	0.6250 % EBIUH 0 5/8 02/09/23 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.60%	996'000.00	0.19	a)
CH0401956815	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 FEB	0	1'000	1'000	0	CHF	98.94%	0.00	0.00	
CH0401956898	0.6970 % COMQAT 0.697 03/22/21 EMT	0	1'000	0	1'000	CHF	99.95%	999'500.00	0.19	a)
CH0406415320	0.1200 % SWICA 2018-1 A	0	1'000	0	1'000	CHF	99.45%	994'500.00	0.19	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	0	1'000	0	1'000	CHF	100.20%	1'002'000.00	0.19	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	1'500	0	1'500	CHF	98.55%	1'478'250.00	0.28	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	0	1'000	0	1'000	CHF	99.50%	995'000.00	0.19	a)
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	0	500	0	500	CHF	99.25%	496'250.00	0.09	a)
CH0409938138	0.3000 % CAF 0.3 04/07/25 APR	0	1'000	1'000	0	CHF	100.80%	0.00	0.00	
CH0409938179	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 MAY	0	1'000	1'000	0	CHF	99.98%	0.00	0.00	
CH0414510054	0.2500 % SCHPSW 0 1/4 06/05/23	0	475	0	475	CHF	99.90%	474'525.00	0.09	a)
CH0417086045	1.0000 % GS 1 11/24/25 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	100.30%	1'003'000.00	0.19	a)
CH0418609613	0.5650 % BREPW 0.565 06/07/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.80%	998'000.00	0.19	a)
CH0418609621	0.6950 % HYUCAP 0.695 06/27/23 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	100.35%	1'003'500.00	0.19	a)
CH0419042509	0.7500 % NESNVX 0 3/4 06/28/28 10Y	0	1'000	0	1'000	CHF	101.40%	1'014'000.00	0.19	a)
CH0419042533	1.3000 % SUNSW 1.3 07/06/23	0	1'000	0	1'000	CHF	100.20%	1'002'000.00	0.19	a)
CH0421460400	0.3825 % EIBKOR 0.3825 07/11/24 EMT	0	1'000	0	1'000	CHF	99.70%	997'000.00	0.19	a)
CH0423233565	0.3000 % JACLIF 0.3 12/18/23 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.80%	998'000.00	0.19	a)
CH0423563540	0.2075 % KORGAS 0.2075 08/02/23 EMT	0	730	0	730	CHF	100.00%	730'000.00	0.14	a)
CH0425766513	0.6250 % SIKA 0 5/8 07/12/24	0	1'000	0	1'000	CHF	100.65%	1'006'500.00	0.19	a)
CH0426621683	1.1250 % BACR 1 1/8 07/12/23 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	100.25%	1'002'500.00	0.19	a)
CH0426621709	0.1500 % CM 0.15 07/31/23 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.90%	999'000.00	0.19	a)
CH0428194200	1.0000 % SANTAN 1 12/10/24 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.90%	999'000.00	0.19	a)
CH0433761274	1.0000 % LHNVDX 1 12/11/24	0	1'000	0	1'000	CHF	100.16%	1'001'610.00	0.19	a)
CH0433761316	0.7500 % ROSW 0 3/4 09/24/30	0	1'000	0	1'000	CHF	99.35%	993'500.00	0.19	a)
CHF								129'369'107.00	24.34	
CH0343366842	1.2500 % CS 1 1/4 07/17/25 EMTN	0	100	0	100	EUR	98.94%	112'254.40	0.02	a)
ES00000126A4	1.8000 % SPGBEI 1.8 11/30/24	1'000	0	0	1'000	EUR	119.16%	1'351'924.59	0.25	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	400	0	0	400	EUR	111.60%	506'441.57	0.10	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	300	0	0	300	EUR	132.10%	449'605.85	0.08	a)
ES0378641056	5.0000 % FADE 5 12/17/26	0	100	0	100	EUR	127.25%	144'371.17	0.03	a)
ES0378641288	0.6250 % FADE 0 5/8 03/17/22	0	100	0	100	EUR	101.00%	114'591.56	0.02	a)
PTOTESOE0013	2.2000 % PGB 2.2 10/17/22	1'000	0	1'000	0	EUR	107.13%	0.00	0.00	
PTOTEUOE0019	4.1250 % PGB 4 1/8 04/14/27	300	200	0	500	EUR	118.99%	675'016.04	0.13	a)
XS1075371986	2.1250 % KOREA 2 1/8 06/10/24	1'000	0	0	1'000	EUR	108.01%	1'225'390.70	0.23	a)
XS1315181708	2.7500 % PERU 2 3/4 01/30/26	450	550	0	1'000	EUR	109.30%	1'240'015.01	0.23	a)
XS1432493879	2.6250 % INDON 2 5/8 06/14/23 REGS	0	1'000	0	1'000	EUR	104.95%	1'190'707.58	0.22	a)
XS1439749281	1.1250 % TEVA 1 1/8 10/15/24	300	0	0	300	EUR	89.03%	303'026.29	0.06	a)
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	0	200	0	200	EUR	94.73%	214'940.02	0.04	a)
EUR								7'528'284.78	1.41	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
FR0000486763	5.5000 % CFF 5 1/2 01/26/27 EMTN	321	0	0	321	GBP	126.87%	518'736.43	0.10	a)
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	1'000	0	0	1'000	GBP	117.48%	1'496'430.11	0.28	a)
XS0355738799	7.6250 % C 7 5/8 04/03/18 EMTN	500	0	500	0	GBP	100.00%	0.00	0.00	
XS0472503589	5.1250 % NAB 5 1/8 12/09/21 GMTN	0	200	200	0	GBP	110.44%	0.00	0.00	
XS0578264870	3.8750 % TOTAL 3 7/8 12/14/18 EMTN	1'200	0	1'200	0	GBP	100.56%	0.00	0.00	
XS0604380724	4.3250 % BPLN 4.325 12/10/18 EMTN	600	0	600	0	GBP	100.59%	0.00	0.00	
XS0616897616	5.1250 % SANUK 5 1/8 04/14/21 EMTN	1'100	0	0	1'100	GBP	109.23%	1'530'476.13	0.29	a)
XS1221677476	2.1250 % WFC 2 1/8 04/22/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	GBP	100.25%	1'276'967.92	0.24	a)
XS1327014749	2.6250 % MET 2 5/8 12/05/22 GMTN	0	200	0	200	GBP	103.73%	264'259.18	0.05	a)
XS1550975079	3.1250 % BACR 3 1/8 01/17/24 EMTN	0	1'000	0	1'000	GBP	99.45%	1'266'739.21	0.24	a)
XS1730883961	1.0000 % NESNVX 1 06/11/21 EMTN	0	500	500	0	GBP	99.15%	0.00	0.00	
GBP								6'353'608.98	1.20	
US00037BAB80	2.8750 % ABBNVX 2 7/8 05/08/22	1'500	0	0	1'500	USD	98.14%	1'438'005.85	0.27	a)
US00254EMN93	1.7500 % SEK 1 3/4 05/18/20	1'500	200	0	1'700	USD	98.07%	1'628'527.80	0.31	a)
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	600	0	600	USD	93.43%	547'592.13	0.10	a)
US05252BAN91	5.1000 % ANZ 5.1 01/13/20 REGS	0	200	0	200	USD	102.42%	200'087.71	0.04	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	97.88%	956'062.54	0.18	a)
US05957PAR73	6.0000 % BANBRA 6 01/22/20 REGS	0	500	500	0	USD	102.76%	0.00	0.00	
US05971BAD10	5.5000 % BTGPBZ 5 1/2 01/31/23 REGS	0	500	0	500	USD	94.28%	460'448.87	0.09	a)
US06051GEH83	5.0000 % BAC 5 05/13/21 MTN	0	200	0	200	USD	104.08%	203'328.73	0.04	a)
US12189LAL53	3.0500 % BNSF 3.05 09/01/22	0	300	0	300	USD	99.39%	291'255.39	0.05	a)
US17275RBJ05	1.8500 % CSCO 1.85 09/20/21	0	50	0	50	USD	96.38%	47'072.48	0.01	a)
US172967JJ16	2.4000 % C 2.4 02/18/20	1'500	100	0	1'600	USD	99.00%	1'547'235.57	0.29	a)
US172967KK69	2.7000 % C 2.7 03/30/21	0	200	0	200	USD	98.27%	191'972.46	0.04	a)
US191216AR14	3.1500 % KO 3.15 11/15/20	1'000	0	0	1'000	USD	100.29%	979'671.69	0.18	a)
US21688AAE29	3.3750 % RABOBK 3 3/8 05/21/25 MTN	0	250	0	250	USD	97.56%	238'229.31	0.04	a)
US219868BS46	4.3750 % CAF 4 3/8 06/15/22	1'150	0	0	1'150	USD	102.47%	1'151'110.94	0.22	a)
US225433AT80	3.8000 % CS 3.8 06/09/23	500	0	0	500	USD	98.80%	482'553.85	0.09	a)
US22546QAP28	3.6250 % CS 3 5/8 09/09/24 MTN	500	0	0	500	USD	98.52%	481'157.03	0.09	a)
US25215DAP42	1.8750 % DEXGRP 1 7/8 01/29/20 REGS	0	200	200	0	USD	98.53%	0.00	0.00	
US369604BH58	4.5000 % GE 4 1/2 03/11/44	500	0	0	500	USD	94.31%	460'610.04	0.09	a)
US404280AN99	4.0000 % HSBC 4 03/30/22	0	200	0	200	USD	101.19%	197'684.78	0.04	a)
US404280BF56	2.6500 % HSBC 2.65 01/05/22	1'000	200	0	1'200	USD	97.07%	1'137'827.43	0.21	a)
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	500	0	0	500	USD	107.33%	524'209.49	0.10	a)
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	500	100	200	400	USD	104.46%	408'161.74	0.08	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	0	200	0	200	USD	100.71%	196'741.21	0.04	a)
US500769FH22	2.0000 % KFW 2 10/04/22	0	300	300	0	USD	95.98%	0.00	0.00	
US59156RAX61	4.7500 % MET 4 3/4 02/08/21	0	200	0	200	USD	103.22%	201'654.50	0.04	a)
US594918BA18	2.3750 % MSFT 2 3/8 02/12/22	0	200	0	200	USD	97.63%	190'731.92	0.04	a)
US742718EP07	2.7000 % PG 2.7 02/02/26	0	200	0	200	USD	94.70%	185'002.01	0.03	a)
US74432QCB95	2.3500 % PRU 2.35 08/15/19 MTN	0	200	0	200	USD	99.56%	194'492.60	0.04	a)
US857524AB80	5.0000 % POLAND 5 03/23/22	1'000	0	0	1'000	USD	105.20%	1'027'613.14	0.19	a)
US87973RAC43	2.3750 % TEMASE 2 3/8 01/23/23 REGS	1'250	0	1'250	0	USD	95.91%	0.00	0.00	
US87973RAD26	3.3750 % TEMASE 3 3/8 07/23/42 REGS	500	0	500	0	USD	93.51%	0.00	0.00	
US88032XAE40	2.9850 % TENCNT 2.985 01/19/23 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	96.78%	945'337.27	0.18	a)
US91911TAM53	4.3750 % VALEBZ 4 3/8 01/11/22	1'000	0	683	317	USD	101.02%	312'803.99	0.06	a)
USA8372TAF50	6.0000 % SUZANO 6 01/15/29 REGS	0	200	0	200	USD	100.48%	196'289.91	0.04	a)
USP06518AG23	6.0000 % BAHAMA 6 11/21/28 REGS	0	200	200	0	USD	101.55%	0.00	0.00	
USP1905CAE05	4.7500 % BRFSBZ 4 3/4 05/22/24 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	91.23%	891'105.34	0.17	a)
USP4949BAJ37	3.8750 % BIMBOA 3 7/8 06/27/24 REGS	1'000	700	0	1'700	USD	98.32%	1'632'712.41	0.31	a)
USP7088CTF33	5.3750 % NATURA 5 3/8 02/01/23 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	97.03%	947'759.74	0.18	a)
USQ98229AM12	3.7000 % WPLAU 3.7 03/15/28 REGS	200	0	0	200	USD	93.95%	183'538.77	0.03	a)
USU75000BD74	3.3500 % ROSW 3.35 09/30/24 REGS	1'000	200	0	1'200	USD	98.96%	1'159'910.93	0.22	a)
USY5749LAA99	3.0430 % MALAYS 3.043 04/22/25 REGS	0	500	0	500	USD	95.41%	465'972.67	0.09	a)
XS0070553820	0.0000 % EIB 0 11/06/26	0	200	0	200	USD	76.28%	149'024.52	0.03	a)
XS0455643394	6.0000 % LHNVX 6 12/30/19 REGS	500	0	0	500	USD	103.16%	503'813.90	0.09	a)
XS0485991417	7.3750 % LITHUN 7 3/8 02/11/20 REGS	2'000	0	0	2'000	USD	105.80%	2'066'986.94	0.39	a)
XS0592582653	4.3750 % BNG 4 3/8 02/16/21 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	103.02%	1'006'318.90	0.19	a)
XS0938722666	4.1250 % GLENLN 4 1/8 05/30/23 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	99.73%	974'191.94	0.18	a)
XS1041751980	2.5000 % ICBCAS 2 1/2 11/21/17 EMTN	1'000	0	1'000	0	USD	100.00%	0.00	0.00	
XS1197036541	1.6250 % NEDWBK 1 5/8 03/04/20 REGS	0	200	200	0	USD	98.23%	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	0	200	0	200	USD	93.93%	183'509.46	0.03	a)
XS1231116481	2.0000 % SWEDA 2 05/12/20	1'000	0	0	1'000	USD	98.22%	959'373.17	0.18	a)
XS1405781342	3.6250 % OMAN 3 5/8 06/15/21 REGS	300	0	0	300	USD	97.78%	286'522.79	0.05	a)
XS1433450258	2.6641 % KBN 0 06/16/20 REGS	800	200	1'000	0	USD	100.54%	0.00	0.00	
XS1485745704	2.1250 % QNBK 2 1/8 09/07/21 EMTN	600	0	0	600	USD	95.34%	558'751.09	0.11	a)
XS1622312434	2.7500 % NTBKKK 2 3/4 05/30/22 REGS	500	0	0	500	USD	96.36%	470'632.01	0.09	a)
XS1711039591	2.7500 % SDBC 2 3/4 11/16/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	USD	96.41%	941'771.95	0.18	a)
XS1830984628	3.0615 % ICBKAS 0 06/14/21 EMTN	0	1'000	0	1'000	USD	99.89%	975'764.59	0.18	a)
USD								31'381'133.50	5.91	
Bezugsrechte								0.00	0.00	
CH0382671664	CS REF GREEN PR BEZUGSRECHT 201	0	9'326	9'326	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0385998353	UBS PROPERTY FUND - SWISS RE	0	18'000	18'000	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0386890344	FONDS IMMOBILIER ROMAND-RTS	0	4'104	4'104	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0395719070	SCHRODER IMMOPLUS-RIGHTS	0	850	850	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0412174762	IMMO HELVETIC-RTS	0	3'003	3'003	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0423561494	BONHOTE IMMOB BEZUGSRECHT 2018	0	3'135	3'135	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
DE000A2LQ1S0	DEUTSCHE LUFTHANSA AG	0	16'802	16'802	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06139009Q9	BANCO SANTANDER SA-RTS	0	21'305	21'305	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809F4	IBERDROLA SA-RTS	0	58'093	58'093	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809G2	IBERDROLA SA-RTS	0	60'585	60'585	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06735169B1	REPSOL SA-RTS	0	30'952	30'952	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06735169C9	REPSOL SA-RTS	0	35'011	35'011	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013283116	TOTAL SA-SCRIP	8'836	0	8'836	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013301744	TOTAL SA-SCRIP	0	9'028	9'028	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013321452	TOTAL SA-SCRIP	0	11'558	11'558	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013333374	TOTAL SA-SCRIP	0	12'878	12'878	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013358967	TOTAL SA-SCRIP	0	12'985	0	12'985	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
IT0005333874	RIGHTS INTESA SANPAOLO SPA	0	132'579	132'579	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012650592	UNILEVER NV-SCRIP	0	16'583	16'583	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012661888	ROYAL DUTCH SHELL PLC-SCRIP	0	8'323	8'323	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
Diverse								0.00	0.00	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								25'844'378.40	4.86	
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INT	3'705	0	0	3'705	CHF	189.80	703'209.00	0.13	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	2'800	843	0	3'643	CHF	206.50	752'279.50	0.14	a)
CH0002782263	LA FONCIERE	650	10'300	650	10'300	CHF	106.40	1'095'920.00	0.21	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	2'600	1'000	0	3'600	CHF	255.00	918'000.00	0.17	a)
CH0007251413	SWISS RE IMMOPLUS	850	0	850	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0009778769	IMMOFONDS	2'520	0	0	2'520	CHF	428.00	1'078'560.00	0.20	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	13'310	0	0	13'310	CHF	186.90	2'487'639.00	0.47	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDEN	18'000	11'200	0	29'200	CHF	67.40	1'968'080.00	0.37	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDEN	7'195	4'900	0	12'095	CHF	94.30	1'140'558.50	0.21	a)
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MI.	36'480	11'500	0	47'980	CHF	106.90	5'129'062.00	0.96	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMEF	13'000	7'200	0	20'200	CHF	67.30	1'359'460.00	0.26	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	4'100	513	0	4'613	CHF	180.00	830'340.00	0.16	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTM	4'100	0	0	4'100	CHF	165.20	677'320.00	0.13	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDE	17'000	0	0	17'000	CHF	14.75	250'750.00	0.05	a)
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	1'335	2'985	0	4'320	CHF	134.70	581'904.00	0.11	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	12'566	0	0	12'566	CHF	130.00	1'633'580.00	0.31	a)
CH0033624211	PROCIMMO SWISS COMMERCIAL	0	3'200	0	3'200	CHF	155.00	496'000.00	0.09	a)
CH0034995214	PATRIMONIUM SWISS REAL ESTATE FU	0	2'600	0	2'600	CHF	149.00	387'400.00	0.07	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	9'326	700	0	10'026	CHF	127.50	1'278'315.00	0.24	a)
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	2'000	4'400	0	6'400	CHF	131.00	838'400.00	0.16	a)
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	0	8'000	0	8'000	CHF	10.85	86'800.00	0.02	a)
CH0037430946	SWC (CH) REAL ESTATE FUND IFCA FA C	5'800	1'847	0	7'647	CHF	126.20	965'051.40	0.18	a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	0	7'650	0	7'650	CHF	155.00	1'185'750.00	0.22	a)
CH								25'844'378.40	4.85	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden								69'898'756.62	13.16	
Strukturierte Produkte								17'410'645.46	3.28	
CH0048232224	ZKB TRACKER-ZERTIFIKAT AUF Q-MA ¹	104'144	118'698	0	222'842	CHF	78.13	17'410'645.46	3.28	a)
CH								17'410'645.46	3.28	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								52'488'111.16	9.88	
CH0019509238	SWC (CH) EF GLOBAL FINANCIALS AA C	11'051	0	0	11'051	CHF	876.14	9'682'223.14	1.82	a)
CH0022736166	SWC (CH) EF GLOBAL RESSOURCES AA	5'085	0	5'085	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0022736174	SWC (CH) EF GLOBAL CONSUMERS AA	5'533	0	5'533	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0022736182	SWC (CH) EF GLOBAL INFRASTRUCTUR	10'408	0	10'408	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0388442359	SWC (CH) EF SMC SITZERLAND (II) NT	0	139'513	0	139'513	CHF	105.72	14'749'288.14	2.78	a)
CH0039299513	SWC (CH) EF HQ SWITZERLAND NT	3'966	0	3'966	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0117044971	SWC (CH) INDEX EF EMERGING MARK	107'837	88'141	0	195'978	CHF	117.57	23'040'427.94	4.34	a)
CH0269985369	BB ADAMANT GLOBAL GENERIKA GT C	6'647	0	6'647	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0269987407	BB ADAMANT GLOBAL MEDTECH UND	13'402	0	13'402	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0269987431	BB ADAMANT GLOBAL BIOTECH GT CH	6'505	0	6'505	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH								47'471'939.22	8.94	
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	12'514	0	0	12'514	USD	265.77	3'248'736.28	0.61	a)
LU0555020998	NN L-EM MK DB HC-IC	237	0	0	237	USD	7'621.57	1'767'435.66	0.33	a)
LU0637847533	LACUNA SICAV-ASIA PACIF HE-I	366	0	366	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
LU0866272569	SWC (LU) EF SUSTAINABLE EMERGING	0	12'713	12'713	0	USD	0.00	0.00	0.00	
LU								5'016'171.94	0.94	
Nicht kotierte Wertpapiere								0.00	0.00	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								0.00	0.00	
CH0118075610	7.0000 % FTIMB 7 10/31/15 TIMB	900	0	0	900	USD	0.00%	0.00	0.00	c)
USD								0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente								15'435.91	0.00	
Futures								0.00	0.00	
12/17 NIKKEI 225 (SGX) DEC17		0	3	3	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
12/17 TOPIX INDEX FUTR DEC17		1	4	5	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
12/17 S&P/TSX 60 IX FUT DEC17		-14	14	0	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
12/17 S&P 500 EMINI FUT DEC17		-147	148	1	0	USD	0.00	0.00	0.00	
12/17 MINI MSCI EMG MKT DEC17		302	36	338	0	USD	0.00	0.00	0.00	
12/17 SWISS MID CAP FUT DEC17		49	55	104	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/17 SWISS MKT IX FUTR DEC17		132	23	155	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/17 EURO STOXX 50 DEC17		-385	398	13	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
12/17 FTSE 100 IDX FUT DEC17		-125	139	14	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
12/17 ASX SPI 200 INDEX DEC17		-3	3	0	0	AUD	0.00	0.00	0.00	
03/18 TOPIX INDEX FUTR MAR18		0	131	131	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
03/18 S&P/TSX 60 IX FUT MAR18		0	73	73	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
03/18 ASX SPI 200 INDEX MAR18		0	3	3	0	AUD	0.00	0.00	0.00	
03/18 S&P 500 EMINI FUT MAR18		0	116	116	0	USD	0.00	0.00	0.00	
03/18 MINI MSCI EMG MKT MAR18		0	423	423	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/18 TOPIX INDEX FUTR JUN18		0	87	87	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
06/18 S&P 500 EMINI FUT JUN18		0	52	52	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/18 MINI MSCI EMG MKT JUN18		0	470	470	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/18 S&P/TSX 60 IX FUT JUN18		0	142	142	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
06/18 ASX SPI 200 INDEX JUN18		0	2	2	0	AUD	0.00	0.00	0.00	
09/18 TOPIX INDEX FUTR SEP18		0	98	98	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
09/18 S&P/TSX 60 IX FUT SEP18		0	78	78	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
09/18 SPI 200 FUTURES SEP18		0	2	2	0	AUD	0.00	0.00	0.00	
09/18 S&P500 EMINI FUT SEP18		0	44	44	0	USD	0.00	0.00	0.00	
09/18 MINI MSCI EMG MKT SEP18		0	374	374	0	USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
12/18	TOPIX INDX FUTR DEC18	0	0	11	-11	JPY	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	S&P/TSX 60 IX FUT DEC18	0	0	9	-9	CAD	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	S&P500 EMINI FUT DEC18	0	33	0	33	USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	MSCI EMGMKT DEC18	0	129	0	129	USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/18	SWISS MKT IX FUTR MAR18	0	204	204	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/18	SWISS MID CAP FUT MAR18	0	72	72	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/18	EURO STOXX 50 MAR18	0	340	340	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
06/18	EURO STOXX 50 JUN18	0	514	514	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
09/18	EURO STOXX 50 SEP18	0	560	560	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
12/18	EURO STOXX 50 DEC18	0	0	432	-432	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	DAX INDEX FUTURE DEC18	0	28	0	28	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	SWISS MKT IX FUTR DEC18	0	56	0	56	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	SWISS MID CAP FUT DEC18	0	72	0	72	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/18	SWISS MKT IX FUTR JUN18	0	212	212	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/18	SWISS MID CAP FUT JUN18	0	72	72	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/18	DAX INDEX FUTURE SEP18	0	28	28	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
09/18	SWISS MKT IX FUTR SEP18	0	233	233	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/18	SWISS MID CAP FUT SEP18	0	72	72	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/18	FTSE 100 IDX FUT JUN18	0	61	61	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
03/18	FTSE 100 IDX FUT MAR18	0	139	139	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
09/18	FTSE 100 IDX FUT SEP18	0	60	60	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
12/18	FTSE 100 IDX FUT DEC18	0	0	60	-60	GBP	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte		Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JPY/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	1'438'478	JPY	166'300'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	10'793'364	USD	11'125'000	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	410'520	NOK	3'300'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	15'974'707	GBP	12'170'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.10.2017	CAD	4'710'000	CHF	3'707'147	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	6'061'624	EUR	5'250'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	744'822	HKD	6'000'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	4'701'362	AUD	6'100'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	10'338'137	USD	10'700'000	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.10.2017	EUR	7'000'000	CHF	8'004'682	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	232'068	CAD	300'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	429'839	JPY	50'000'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 27.10.2017	GBP	110'000	CHF	142'511	0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 27.10.2017	HKD	1'500'000	CHF	185'765	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.11.2017	CAD	4'410'000	CHF	3'407'541	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	569'331	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	4'638'806	AUD	6'100'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	1'882'751	JPY	216'300'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	21'554'043	USD	21'825'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	15'811'806	GBP	12'060'000	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.11.2017	EUR	1'750'000	CHF	2'045'059	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	406'346	NOK	3'300'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.11.2017	CAD	200'000	CHF	154'720	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	9'639'911	EUR	8'300'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	7'967'416	USD	8'000'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.11.2017	CAD	350'000	CHF	272'055	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.11.2017	EUR	1'100'000	CHF	1'281'918	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	519'540	GBP	400'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 27.11.2017	JPY	80'000'000	CHF	699'284	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 27.11.2017	NOK	1'000'000	CHF	120'930	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.11.2017	USD	1'000'000	CHF	991'110	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	277'201	NOK	2'300'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	1'201'035	JPY	136'300'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	564'458	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	16'244'850	GBP	12'460'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	6'334'344	EUR	5'450'000	0.00	0.00	

			Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CHF/CAD	Verfall	22.12.2017	CAD	4'960'000	CHF	3'819'919	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	22.12.2017	CHF	4'554'504	AUD	6'100'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	22.12.2017	CHF	28'231'926	USD	28'825'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	22.12.2017	CHF	7'932'132	CAD	10'400'000	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	22.12.2017	EUR	3'000'000	CHF	3'511'350	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	22.12.2017	JPY	45'000'000	CHF	395'303	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	22.12.2017	USD	16'000'000	CHF	15'700'800	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall	22.12.2017	NOK	800'000	CHF	94'170	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	12'612'233	USD	12'825'000	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	177'098	NOK	1'500'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	795'031	JPY	91'300'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	4'602'517	AUD	6'100'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	4'170'114	CAD	5'440'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	2'863'168	EUR	2'450'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	16'455'797	GBP	12'460'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	566'393	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	9'285'492	CAD	12'000'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	2'878'649	JPY	330'000'000	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall	30.01.2018	NOK	200'000	CHF	23'736	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall	30.01.2018	CAD	24'000'000	CHF	18'645'120	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	12'869'395	EUR	11'000'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall	30.01.2018	GBP	800'000	CHF	1'055'504	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	30.01.2018	JPY	2'650'000'000	CHF	22'983'583	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	30.01.2018	CHF	5'847'960	USD	6'000'000	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	26.02.2018	CHF	158'005	NOK	1'300'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall	26.02.2018	CAD	6'560'000	CHF	4'974'881	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	26.02.2018	CHF	15'521'675	GBP	11'660'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall	26.02.2018	CHF	538'502	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	26.02.2018	JPY	2'228'700'000	CHF	19'060'489	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	26.02.2018	CHF	15'661'516	EUR	13'450'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	26.02.2018	CHF	17'623'306	USD	18'825'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall	26.02.2018	GBP	250'000	CHF	330'334	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall	26.02.2018	CAD	1'000'000	CHF	754'924	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall	26.02.2018	NOK	400'000	CHF	48'392	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	26.02.2018	EUR	860'000	CHF	995'958	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall	26.02.2018	CHF	12'754'650	JPY	1'500'000'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	26.02.2018	USD	11'000'000	CHF	10'229'450	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	28.02.2018	CHF	4'610'136	AUD	6'100'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall	28.02.2018	AUD	18'100'000	CHF	13'469'568	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	28.02.2018	CHF	1'845'100	AUD	2'500'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall	28.02.2018	CHF	6'960'992	AUD	9'500'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall	07.03.2018	AUD	750'000	CHF	543'731	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	27.03.2018	CHF	106'735	NOK	900'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	27.03.2018	CHF	7'303'026	USD	7'825'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	27.03.2018	JPY	728'700'000	CHF	6'371'367	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	27.03.2018	CHF	14'502'648	EUR	12'590'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall	27.03.2018	AUD	9'500'000	CHF	6'946'581	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall	27.03.2018	CAD	7'560'000	CHF	5'544'587	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall	27.03.2018	CHF	537'030	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	27.03.2018	CHF	14'848'734	GBP	11'410'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall	27.03.2018	GBP	380'000	CHF	494'056	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall	27.03.2018	EUR	400'000	CHF	460'197	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	27.03.2018	JPY	160'000'000	CHF	1'412'235	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall	27.03.2018	NOK	86'000'000	CHF	10'291'276	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall	27.03.2018	USD	6'000'000	CHF	5'653'350	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	27.03.2018	CHF	8'824'080	CAD	12'000'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall	27.04.2018	AUD	9'500'000	CHF	6'923'344	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall	27.04.2018	CHF	3'247'696	CAD	4'440'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall	27.04.2018	CHF	14'237'067	EUR	12'190'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall	27.04.2018	CHF	14'707'623	GBP	11'030'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall	27.04.2018	CHF	1'724'169	USD	1'825'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall	27.04.2018	JPY	888'700'000	CHF	8'017'878	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall	27.04.2018	CHF	542'214	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall	27.04.2018	CHF	109'463	NOK	900'000	0.00	0.00	

		Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
JPY/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	808'696	JPY	90'000'000	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 27.04.2018	NOK	900'000	CHF	109'406	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.04.2018	EUR	4'800'000	CHF	5'652'624	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	11'355'145	AUD	15'500'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.04.2018	USD	10'000'000	CHF	9'546'500	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 27.04.2018	GBP	7'300'000	CHF	9'804'849	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.04.2018	CAD	12'000'000	CHF	8'883'360	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	2'158'309	GBP	1'600'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	4'452'084	AUD	6'000'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.06.2018	USD	8'175'000	CHF	8'017'476	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	562'802	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	8'856'124	EUR	7'390'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.06.2018	CAD	7'560'000	CHF	5'757'016	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.06.2018	JPY	798'700'000	CHF	7'192'709	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	7'299'248	GBP	5'330'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.06.2018	GBP	3'700'000	CHF	5'029'802	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	14'474'056	EUR	12'100'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.06.2018	AUD	6'700'000	CHF	4'996'847	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.06.2018	JPY	490'000'000	CHF	4'439'327	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	16'151'142	EUR	14'000'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	11'351'747	GBP	8'630'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.07.2018	USD	10'000'000	CHF	9'819'270	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.07.2018	JPY	1'300'000'000	CHF	11'688'053	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 05.07.2018	AUD	700'000	CHF	526'249	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	563'603	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	4'182'393	CAD	5'500'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	16'205'742	EUR	14'000'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 08.08.2018	JPY	600'000'000	CHF	5'371'566	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	7'850'280	GBP	6'000'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	568'080	HKD	4'500'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	34'630'050	USD	35'000'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 08.08.2018	CAD	8'500'000	CHF	6'396'080	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	8'780'040	AUD	12'000'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	5'796'977	GBP	4'500'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	4'601'404	EUR	4'000'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	34'743'345	USD	35'000'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	8'811'804	AUD	12'000'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	1'788'010	JPY	200'000'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 07.09.2018	CAD	22'000'000	CHF	16'804'700	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.10.2018	CHF	33'936'175	USD	35'000'000	-237'022.78	-0.04	b)
JPY/CHF	Verfall 05.10.2018	CHF	1'742'072	JPY	200'000'000	22'310.35	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 05.10.2018	CHF	5'660'676	GBP	4'500'000	-70'190.99	-0.01	b)
EUR/CHF	Verfall 05.10.2018	CHF	4'513'620	EUR	4'000'000	-24'324.76	0.00	b)
CHF/CAD	Verfall 05.10.2018	CAD	22'000'000	CHF	16'175'720	444'449.75	0.07	b)
AUD/CHF	Verfall 05.10.2018	CHF	8'358'192	AUD	12'000'000	-119'785.66	-0.02	b)
Devisentermingeschäfte						15'435.91	0.00	

Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht	46'441'777.77	8.74
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	180'070'276.97	33.88
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	179'723'322.20	33.82
Strukturierte Produkte	17'410'645.46	3.28
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	78'332'489.56	14.74
Andere Anlagen - Metallkonten	26'806'599.57	5.04
Derivative Finanzinstrumente	15'435.91	0.00
Sonstige Vermögenswerte	2'668'079.67	0.50
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	531'468'627.11	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-7.79	
Andere Verbindlichkeiten	-584'888.39	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	530'883'730.93	

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);	455'536'734.19	85.72
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	15'435.91	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

27'321'607.27 5.14

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte				533'975.61	0.10
FR0000125585	CASINO GUICHARD PERRACHON	2'431 EUR	36.22	99'897.84	0.02
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	19'778 GBP	1'723.00	434'077.77	0.08
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				26'787'631.66	5.04
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	300 CHF	114.70%	344'100.00	0.06
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	100 CHF	107.25%	107'250.00	0.02
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	150 CHF	112.25%	168'375.00	0.03
CH0204567322	1.3750 % CAF 1 3/8 02/11/21 EMTN	560 CHF	103.25%	578'200.00	0.11
CH0229751927	2.5000 % BANBRA 2 1/2 06/20/19 EMTN	300 CHF	101.10%	303'300.00	0.06
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	500 CHF	99.45%	497'250.00	0.09
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	1'500 CHF	107.30%	1'609'500.00	0.30
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449	500 CHF	105.58%	527'900.00	0.10
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000 CHF	98.25%	982'500.00	0.19
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	700 CHF	100.50%	703'500.00	0.13
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000 CHF	102.60%	1'026'000.00	0.19
CH0307256401	0.0300 % ZKB 0.03 02/11/22 137	1'000 CHF	100.80%	1'008'000.00	0.19
CH0310451841	0.7500 % UBS 0 3/4 02/22/22	800 CHF	101.45%	811'600.00	0.15
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	500 CHF	100.45%	502'250.00	0.09
CH0311427626	0.3710 % CABEI 0.371 08/26/22 EMTN	500 CHF	100.20%	501'000.00	0.09
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	400 CHF	99.55%	398'200.00	0.08
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	300 CHF	97.95%	293'850.00	0.06
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	200 CHF	98.65%	197'300.00	0.04
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'000 CHF	97.60%	976'000.00	0.18
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	500 CHF	100.00%	500'000.00	0.09
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	250 CHF	97.80%	244'500.00	0.05
US00254EMN93	1.7500 % SEK 1 3/4 05/18/20	1'700 USD	98.07%	1'628'527.80	0.31
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	500 USD	97.88%	478'031.27	0.09
US05971BAD10	5.5000 % BTGPBZ 5 1/2 01/31/23 REGS	500 USD	94.28%	460'448.87	0.09
US21688AAE29	3.3750 % RABOBK 3 3/8 05/21/25 MTN	250 USD	97.56%	238'229.31	0.04
US219868BS46	4.3750 % CAF 4 3/8 06/15/22	1'150 USD	102.47%	1'151'110.94	0.22
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	500 USD	107.33%	524'209.49	0.10

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	388	USD	104.46%	395'916.89	0.07	
US857524AB80	5.0000 % POLAND 5 03/23/22	784	USD	105.20%	805'648.70	0.15	
US91911TAM53	4.3750 % VALEBZ 4 3/8 01/11/22	317	USD	101.02%	312'803.99	0.06	
USP1905CAE05	4.7500 % BRFSBZ 4 3/4 05/22/24 REGS	1'000	USD	91.23%	891'105.34	0.17	
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	1'000	GBP	117.48%	1'496'430.11	0.28	
XS0592582653	4.3750 % BNG 4 3/8 02/16/21 REGS	800	USD	103.02%	805'055.12	0.15	
XS0616897616	5.1250 % SANUK 5 1/8 04/14/21 EMTN	1'100	GBP	109.23%	1'530'476.13	0.29	
XS0938722666	4.1250 % GLENLN 4 1/8 05/30/23 REGS	900	USD	99.73%	876'772.75	0.17	
XS1075371986	2.1250 % KOREA 2 1/8 06/10/24	500	EUR	108.01%	612'695.35	0.12	
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	200	USD	93.93%	183'509.46	0.03	
XS1231116481	2.0000 % SWEDA 2 05/12/20	1'000	USD	98.22%	959'373.17	0.18	
XS1711039591	2.7500 % SDBC 2 3/4 11/16/22 EMTN	1'000	USD	96.41%	941'771.95	0.18	
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	200	EUR	94.73%	214'940.02	0.04	

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Umrechnungskurse	AUD	1 = CHF	0.70676364
	CAD	1 = CHF	0.75568621
	CNY	1 = CHF	0.14196436
	CZK	100 = CHF	4.40064400
	DKK	100 = CHF	15.21412400
	EUR	1 = CHF	1.13454748
	GBP	1 = CHF	1.27379604
	HKD	100 = CHF	12.48322700
	HUF	100 = CHF	0.35077200
	JPY	100 = CHF	0.85997300
	SEK	100 = CHF	10.98367300
	SGD	1 = CHF	0.71489735
	USD	1 = CHF	0.97680000
	ZAR	1 = CHF	0.06902570

Collateral ausgeliehene Effekten

Collateral in Fondswährung	Aktien	Obligationen
30'465'409.99	40.07 %	59.93 %

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

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II

Total der Derivatpositionen	in Fondswährung	in % des Nettofondsvermögens *
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	124'703'783.15	23.49
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	25'414'583.43	4.79
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	27'321'607.27	5.14

* In Prozent der Risikolimite (= Nettofondsvermögen * Limitenfaktor). Der Limitenfaktor ist ein im Fondsvertrag festgelegter Relativwert, der das Verhältnis der Risikolimite zum Nettofondsvermögen angibt. Ist im Fondsvertrag nichts anderes bestimmt, so beträgt der Limitenfaktor 100 %.

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung per 30.09.2018

Klasse	Rechnungseinheit	Ausgabespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes		Rücknahmespesen bzw. -kommission in % des Nettoinventarwertes	
		zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung	zu Gunsten Teilvermögen	zu Gunsten Fondsleitung
AA CHF	CHF	n/a	0.00	n/a	0.00
CT CHF	CHF	n/a	0.00	n/a	0.00

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten:	27'321'607.27
Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten:	0.00
Hinweis auf Soft Commission Agreements:	Ein Teil der Aufträge wird über Gebührenteilungsvereinbarungen (Commission Sharing Agreements) durchgeführt.

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:

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I - Balance

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF	max. PVK p.a.	max. VK Zielfonds p.a.
AA 19)	01.10.2017 – 15.10.2017	1.40 %	n/a	n/a	n/a	4.00 %
AA CHF	16.10.2017 – 30.09.2018	1.35 %	1.10 %	0.25 %	2.00 %	4.00 %
CT CHF	16.11.2017 – 30.09.2018	0.73 %	0.48 %	0.25 %	1.30 %	4.00 %

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 Fondsvermögens bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fondsvermögens. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fondsvermögen belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

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.

Ausschüttung des Nettoertrags 2017 / 2018

Ex Datum: 23.01.2019

Zahlbar: 28.01.2019

			Ausschüttung des Ertrags an Anteilscheininhaber mit Domizil			
			in der Schweiz			im Ausland
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35 % Eidg. Verrechnungssteuer	Netto je Anteil	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	6.20	2.17	4.03	4.03

Ausserordentliche Ausschüttung des Nettoertrags 2017 / 2018

Ex Datum: 31.10.2017

Zahlbar: 03.11.2017

			Ausschüttung des Ertrags an Anteilscheininhaber mit Domizil			
			in der Schweiz			im Ausland
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35 % Eidg. Verrechnungssteuer	Netto je Anteil	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	3.20	1.12	2.08	2.08

Thesaurierung des Nettoertrags 2017 / 2018

Ex Datum: 23.01.2019

Zahlbar: 28.01.2019

				Thesaurierung für Anteilscheininhaber mit Domizil			
				in der Schweiz		im Ausland	
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto- Thesaurierung je Anteil	Abzüglich 35 % Eidg. Verrechnungs- steuer	Netto- Thesaurierung je Anteil	Netto- Thesaurierung je Anteil	Barauszahlung je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	1.012	0.354	0.658	0.658	0.000

Erklärung der Fussnoten (fehlende Fussnoten für diesen Bericht nicht relevant)

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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
- 14) neue Klassenbezeichnung per 16.10.2017 von AA Klasse in AA CHF Klasse
- 19) Änderung Verwaltungskommission in Pauschale Verwaltungskommission im Rahmen der Einführung des neuen Anteilklassenkonzeptes.
- 21) Änderung von Spread auf SSP per 16.10.2017
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart

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 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 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 im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
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 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, 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 jeweiligen Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile des jeweiligen Teilvermögens 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. 5.2.2) näher definierten Periode.

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 Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Bericht der Prüfgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I

mit den Teilvermögen

- Ambition
- Balance
- Focus
- Relax
- Select

bestehend aus den Vermögensrechnungen und den Erfolgsrechnungen, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b - h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) für das am 30. September 2018 abgeschlossene Geschäftsjahr geprüft.

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt verantwortlich. Diese Verantwortung beinhaltet die Ausgestaltung, Implementierung und Aufrechterhaltung eines internen Kontrollsystems, mit Bezug auf die Aufstellung der Jahresrechnungen, die frei von wesentlichen falschen Angaben als Folge von Verstössen oder Irrtümern sind. Darüber hinaus ist der Verwaltungsrat der Fondsleitung für die Auswahl und die Anwendung sachgemässer Rechnungslegungsmethoden sowie die Vornahme angemessener Schätzungen verantwortlich.

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Unsere Verantwortung ist es, aufgrund unserer Prüfung ein Prüfungsurteil über die Jahresrechnungen abzugeben. Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Prüfungsstandards vorgenommen. Nach diesen Standards haben wir die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass wir hinreichende Sicherheit gewinnen, ob die Jahresrechnungen frei von wesentlichen falschen Angaben sind.

Eine Prüfung beinhaltet die Durchführung von Prüfungshandlungen zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die in den Jahresrechnungen enthaltenen Wertansätze und sonstigen Angaben. Die Auswahl der Prüfungshandlungen liegt im pflichtgemässen Ermessen des Prüfers. Dies schliesst eine Beurteilung der Risiken wesentlicher falscher Angaben in den Jahresrechnungen als Folge von Verstössen oder Irrtümern ein. Bei der Beurteilung dieser Risiken berücksichtigt der Prüfer das interne Kontrollsystem, soweit es für die Aufstellung der Jahresrechnungen von Bedeutung ist, um die den Umständen entsprechenden Prüfungshandlungen festzulegen, nicht aber um ein Prüfungsurteil über die Existenz und Wirksamkeit des internen Kontrollsystems abzugeben. Die Prüfung umfasst zudem die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vorgenommenen Schätzungen sowie eine Würdigung der Gesamtdarstellung der Jahresrechnungen. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung entsprechen die Jahresrechnungen für das am 30. September 2018 abgeschlossene Geschäftsjahr dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

Wir bestätigen, dass wir die gesetzlichen Anforderungen an die Zulassung sowie an die Unabhängigkeit gemäss Revisionsaufsichtsgesetz erfüllen und keine mit unserer Unabhängigkeit nicht vereinbare Sachverhalte vorliegen.

Ernst & Young AG

Sandor Frei
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Daniele Fiasco
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 18. Januar 2019