

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»**

Halbjahresbericht per 31. März 2018

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	3
Abschlusszahlen	4
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	25
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	25
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	25
Pauschale Verwaltungskommission	26
Benchmark.....	26
TER.....	26
Erklärung der Fussnoten	26
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	27

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 14.05.2018

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

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

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

Geschäftsführung

Hans Frey
 Geschäftsführer

Andreas Hogg
 stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Markus Erb (bis 31.05.2017)
 Leiter Legal, Compliance & Investment Controlling

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 31.03.2018	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		476'003'614.74	408'403'169.24	402'958'521.93	419'411'228.61
Klasse AA CHF 14)	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		467'939'085.24	408'403'169.24	402'958'521.93	419'411'228.61
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		324'414.627	282'138.264	288'175.000	305'928.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		1'442.41	1'447.53	1'398.31	1'370.95
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		1'442.41	-	-	-
Ausschüttung je Anteil		-	6.40	17.00	15.00
Ausserordentliche Ausschüttung je Anteil		-	-	22.20	-
Total Expense Ratio (synthetische TER)		1.36 %	1.50 %	1.49 %	1.44 %
Klasse CT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'064'529.50			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		81'609.840			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.82			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		98.82			
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 / 31.03.2018	2017	2016	2015
Klasse AA CHF	-2.39 %	8.25 %	1.80 %	-2.20 %
Klasse CT CHF (Lancierung 16.11.2017)	-2.25 %	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)	31.03.2018	30.09.2017
Bankguthaben auf Sicht	36'118'378.47	12'690'845.55
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	154'404'208.26	136'568'371.16
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	182'219'033.65	149'598'003.24
Strukturierte Produkte	17'925'410.48	8'159'682.40
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	66'051'005.82	91'152'035.51
Andere Anlagen - Metallkonten	17'893'850.30	7'950'742.49
Derivative Finanzinstrumente	-206'474.92	322'614.29
Sonstige Vermögenswerte	2'280'891.57	2'404'207.39
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	476'686'303.63	408'846'502.03
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-117'925.62	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-564'763.27	-443'332.79
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	476'003'614.74	408'403'169.24

Entwicklung der Anzahl Anteile	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
Klasse AA CHF	bis	31.03.2018	30.09.2017
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		282'138.264	288'175.000
Ausgegebene Anteile		69'243.130	26'684.053
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		19'174.089	0.000
Zurückgenommene Anteile		-46'140.856	-32'720.789
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		324'414.627	282'138.264

Entwicklung der Anzahl Anteile	Rechnungsperiode	Lancierung 16.11.2017
Klasse CT CHF	bis	31.03.2018
Ausgegebene Anteile		84'479.807
Zurückgenommene Anteile		-2'869.967
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		81'609.840

Veränderung des Nettofondsvermögens (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
	bis	31.03.2018	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		70'201'933.67	-8'565'649.16
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		284'470.23	25'170'613.67
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		476'003'614.74	408'403'169.24

Erfolgsrechnung (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
	bis	31.03.2018	30.09.2017
Ertrag			
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-86'670.75	-17'149.70
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		1'546'191.14	3'253'047.39
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		1'588'818.36	2'936'753.62
Erträge der Gratisaktien		52'517.21	201'809.88
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		638'972.25	1'260'777.91
Erträge aus Wertpapierleihe		23'931.85	50'375.00
Erträge aus Rückvergütung		5'781.44	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		-13'623.02	122'057.29
Total Ertrag		3'737'711.68	7'809'937.07
Aufwand			
Passivzinsen		-290.26	-186.05
Prüfaufwand		-589.77	-8'067.87
Reglementarische Vergütung		-2'826'800.35	-5'117'817.08
Sonstige Aufwendungen		-19'457.19	-25'259.97
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-94'279.57	-155'303.93
Total Aufwand		-2'941'417.14	-5'306'634.90
Nettoertrag / Verlust		796'294.54	2'503'302.17
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		13'553'100.64	2'734'425.00
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		33'423.56	427'660.46
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP) 21)		43'425.34	0.00
Realisierter Erfolg		14'426'244.08	5'665'387.63
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-14'141'773.85	19'505'226.04
Gesamterfolg		284'470.23	25'170'613.67

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

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.10.2017	Käufe / Zugänge 2) 31.03.2018	Verkäufe / Abgänge 3) 31.03.2018	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.03.2018	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind									376'632'537.34	75.24
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte									154'404'208.26	32.39
AT0000743059	OMV AG	2'936	472	762	2'646	EUR	47.28	147'333.72	0.03	a)
AT0000938204	MAYR-MELNHOF KARTON AG	0	821	821	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
AT									147'333.72	0.03
GB0000566504	BHP BILLITON PLC	8'253	7'488	0	15'741	GBP	1'403.60	296'794.32	0.06	a)
AU									296'794.32	0.06
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	66.18	554'076.98	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	1'750	1'756	EUR	54.25	112'191.28	0.02	a)
BE0974256852	COLRUYT SA	792	0	792	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974264930	AGEAS	0	599	0	599	EUR	41.96	29'600.37	0.01	a)
BE									695'868.63	0.15
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	1'633	0	1'633	0	USD	0.00	0.00	0.00	
BMG5876H1051	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	25'128	4'539	5'419	24'248	USD	21.00	487'617.58	0.10	a)
BM									487'617.58	0.10
CA01626P4033	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	0	6'062	0	6'062	CAD	57.67	259'664.68	0.05	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	23'972	0	23'972	CAD	23.84	424'480.28	0.09	a)
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	0	900	0	900	CAD	97.32	65'056.64	0.01	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	0	16'469	0	16'469	CAD	79.36	970'768.97	0.20	a)
CA0679011084	BARRICK GOLD CORP	0	12'889	0	12'889	CAD	16.05	153'653.08	0.03	a)
CA0977512007	BOMBARDIER INC-B	0	228'303	44'784	183'519	CAD	3.75	511'162.87	0.11	a)
CA1254911003	CI FINANCIAL CORP	0	29'503	23'296	6'207	CAD	27.60	127'244.15	0.03	a)
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	0	1'194	CAD	40.50	35'917.52	0.01	a)
CA22576C1014	CRESCENT POINT ENERGY CORP	0	46'106	0	46'106	CAD	8.76	299'991.22	0.06	a)
CA2918434077	EMPIRE CO LTD 'A'	0	29'205	0	29'205	CAD	25.86	560'961.08	0.12	a)
CA2925051047	ENCANA CORP	0	5'184	5'184	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	0	11'618	8'321	3'297	CAD	40.52	99'228.26	0.02	a)
CA3039011026	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0	415	415	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3180714048	FINNING INTERNATIONAL INC	0	22'802	1'075	21'727	CAD	31.07	501'404.26	0.11	a)
CA3809564097	GOLDCORP INC	0	2'430	0	2'430	CAD	17.79	32'109.18	0.01	a)
CA39138C1068	GREAT-WEST LIFECO INC	0	11'388	0	11'388	CAD	32.88	278'116.19	0.06	a)
CA4480551031	HUSKY ENERGY INC	0	40'457	0	40'457	CAD	18.44	554'117.15	0.12	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	0	13'233	0	13'233	CAD	20.92	205'620.78	0.04	a)
CA4558711038	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	0	12'898	0	12'898	CAD	53.00	507'744.52	0.11	a)
CA47215Q1046	JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	0	26'471	0	26'471	CAD	24.56	482'887.22	0.10	a)
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	107'185	0	107'185	CAD	5.09	405'227.39	0.09	a)
CA53278L1076	LINAMAR CORP	0	5'300	0	5'300	CAD	70.38	277'058.92	0.06	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	42'549	0	42'549	CAD	23.92	755'957.76	0.16	a)
CA68272K1030	ONEX CORPORATION	0	4'499	0	4'499	CAD	92.92	310'507.57	0.07	a)
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	7'794	0	7'794	CAD	40.20	232'719.86	0.05	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	4'466	0	4'466	CAD	99.52	330'123.23	0.07	a)
CA78460T1057	SNC-LAVALIN GROUP INC	0	11'435	0	11'435	CAD	56.57	480'473.40	0.10	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	0	17'366	0	17'366	CAD	52.91	682'471.56	0.14	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	0	3'518	0	3'518	CAD	44.49	116'253.29	0.02	a)
CA8676EP1086	SUNOPTA INC	0	4'338	4'338	0	USD	0.00	0.00	0.00	
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	0	1'171	0	1'171	CAD	33.18	28'858.93	0.01	a)
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	0	12'588	7'055	5'533	CAD	73.11	300'458.47	0.06	a)
CA									9'990'238.43	2.11

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			31.03.2018					
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	268	521	3'405	CHF	473.60	1'612'608.00	0.34	a)
CH0010570759	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0	1	1	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	661	0	113	548	CHF	2'176.00	1'192'448.00	0.25	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8'914	1'199	0	10'113	CHF	313.40	3'169'414.20	0.66	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	122'617	15'039	3'612	134'044	CHF	77.26	10'356'239.44	2.17	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	39'698	3'263	4'117	38'844	CHF	219.10	8'510'720.40	1.79	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	16'867	0	157'745	CHF	15.99	2'522'342.55	0.53	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	14'792	3'685	411	18'066	CHF	68.00	1'228'488.00	0.26	a)
CH0012214059	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	35'255	4'512	1'441	38'326	CHF	52.30	2'004'449.80	0.42	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	66'946	19'682	0	86'628	CHF	22.72	1'968'188.16	0.41	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2'004	1'533	0	3'537	CHF	421.40	1'490'491.80	0.31	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	502	308	3'722	CHF	340.30	1'266'596.60	0.27	a)
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	0	371	371	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0038863350	NESTLE SA-REG	121'328	12'683	4'110	129'901	CHF	75.62	9'823'113.62	2.06	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	31'044	3'646	0	34'690	CHF	97.28	3'374'643.20	0.71	a)
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	13'715	2'977	1'106	15'586	GBP	2'634.00	551'480.72	0.12	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	25'876	1'941	273	27'544	CHF	85.76	2'362'173.44	0.50	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	176'957	24'134	0	201'091	CHF	16.80	3'377'323.35	0.71	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	29'078	7'816	32'294	4'600	EUR	17.99	97'432.33	0.02	a)
CH								54'908'153.61	11.53	
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	0	4'482	0	4'482	EUR	51.10	269'728.97	0.06	a)
DE0005552004	DEUTSCHE POST AG-REG	10'101	3'820	545	13'376	EUR	35.52	559'543.75	0.12	a)
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	11'509	31'185	0	42'694	EUR	13.25	666'219.83	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	595	0	1'764	EUR	79.78	165'740.04	0.03	a)
DE0006048408	HENKEL AG & CO KGAA	0	874	874	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006062144	COVESTRO AG	5'714	1'138	1'035	5'817	EUR	79.86	547'095.58	0.11	a)
DE0006070006	HOCHTIEF AG	0	1'302	902	400	EUR	151.70	71'462.86	0.01	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	
DE0007100000	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	0	448	0	448	EUR	68.97	36'389.25	0.01	a)
DE0007164600	SAP SE	295	1'367	1'662	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	311	905	311	905	EUR	103.52	110'333.57	0.02	a)
DE0007664005	VOLKSWAGEN AG	2'704	421	1'540	1'585	EUR	162.60	303'518.13	0.06	a)
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	3'517	0	1'508	2'009	EUR	161.38	381'825.11	0.08	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16'949	1'801	2'947	15'803	EUR	25.94	482'774.53	0.10	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	723	2'163	723	2'163	EUR	183.40	467'186.93	0.10	a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0	3'145	111	3'034	EUR	188.85	674'788.08	0.14	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	0	21'592	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000BASF111	BASF SE	593	572	0	1'165	EUR	82.47	113'150.57	0.02	a)
DE000BAY0017	BAYER AG-REG	6'984	1'353	7'977	360	EUR	91.79	38'916.40	0.01	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	3'129	47'178	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	0	6'976	2'453	4'523	EUR	28.64	152'557.81	0.03	a)
DE000LED4000	OSRAM LICHT AG	0	1'399	1'399	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000SHA0159	SCHAEFFLER AG	24'773	4'877	2'303	27'347	EUR	12.54	403'709.41	0.08	a)
DE000TUAG000	TUI AG-DI	0	26'795	0	26'795	GBP	1'528.00	549'992.81	0.12	a)
DE								5'994'933.63	1.24	

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			31.03.2018					
ES0111845014	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	12'691	4'675	0	17'366	EUR	18.22	372'634.45	0.08	a)
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	21'305	30'160	4'404	47'061	EUR	5.30	293'468.81	0.06	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	14'220	0	50'029	EUR	3.87	228'135.05	0.05	a)
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	78'092	14'092	31'599	60'585	EUR	5.97	426'108.06	0.09	a)
ES0144583178	IBERDROLA SA-INTERIM	0	1'262	1'262	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173516115	REPSOL SA	28'960	4'142	0	33'102	EUR	14.42	561'957.81	0.12	a)
ES0173516131	REPSOL SA-INTERIM	0	793	793	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								1'882'304.18	0.40	
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	17'381	5'648	3'306	19'723	EUR	14.93	346'674.71	0.07	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	14'841	1'035	7'942	7'934	EUR	30.10	281'250.64	0.06	a)
FI								627'925.35	0.13	
FR0000039299	BOLLORE	0	46'223	0	46'223	EUR	4.33	235'711.55	0.05	a)
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	11'866	6'945	0	18'811	EUR	13.21	292'539.92	0.06	a)
FR0000120222	CNP ASSURANCES	18'523	4'334	1'190	21'667	EUR	20.50	523'103.32	0.11	a)
FR0000120271	TOTAL SA	8'263	5'412	1'559	12'116	EUR	46.13	658'229.82	0.14	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	10'652	1'263	971	10'944	EUR	40.71	524'701.16	0.11	a)
FR0000120578	SANOFI	3'795	1'219	4'114	900	EUR	65.33	69'245.25	0.01	a)
FR0000120628	AXA SA	0	4'228	4'228	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000120685	NATIXIS	56'845	17'311	8'910	65'246	EUR	6.66	511'602.34	0.11	a)
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	0	141	141	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121501	PEUGEOT SA	20'795	1'456	22'251	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	20'387	2'735	1'907	21'215	EUR	19.25	480'834.69	0.10	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	9'614	1'389	449	10'554	EUR	42.86	532'726.24	0.11	a)
FR0000125585	CASINO GUICHARD PERRACHON	1'178	2'285	0	3'463	EUR	39.81	162'360.17	0.03	a)
FR0000130213	LAGARDERE SCA	13'629	2'936	0	16'565	EUR	23.20	452'599.70	0.09	a)
FR0000130452	EIFFAGE	0	2'683	1'312	1'371	EUR	92.48	149'320.73	0.03	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	855	0	855	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	10'608	1'405	11'242	771	EUR	60.17	54'634.78	0.01	a)
FR0000133308	ORANGE	31'894	9'913	1'851	39'956	EUR	13.79	648'669.69	0.14	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	5'437	0	19'896	EUR	13.56	317'614.36	0.07	a)
FR0010221234	EUTELSAT COMMUNICATIONS	16'319	2'730	3'975	15'074	EUR	16.10	285'817.77	0.06	a)
FR0010259150	IPSEN	0	3'089	3'089	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010411983	SCOR SE	10'692	8'573	8'362	10'903	EUR	33.26	427'073.96	0.09	a)
FR								6'326'785.45	1.32	
BMG475671050	IHS MARKIT LTD	0	0	0	0	USD	0.00	0.00	0.00	
ES0177542018	INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	11'396	3'475	3'049	11'822	EUR	7.02	97'737.88	0.02	a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	15'327	6'655	3'565	18'417	GBP	530.40	131'220.69	0.03	a)
GB0002162385	AVIVA PLC	0	59'508	7'966	51'542	GBP	495.90	343'348.59	0.07	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	712.70	153'047.58	0.03	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	157'587	12'031	140'290	29'328	GBP	665.40	262'147.15	0.05	a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	143'983	19'407	70'231	93'159	GBP	257.80	322'617.28	0.07	a)
GB0005758098	MEGGITT PLC	21'365	0	21'365	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0006043169	WM MORRISON SUPERMARKETS	144'455	10'708	67'800	87'363	GBP	213.50	250'556.30	0.05	a)
GB0006825383	PERSIMMON PLC	8'845	951	4'461	5'335	GBP	2'530.00	181'315.46	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	20'788	26'014	156'019	GBP	479.25	1'004'429.61	0.21	a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	174'642	68'732	0	243'374	GBP	64.66	211'392.60	0.04	a)
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	25'165	23'004	9'425	38'744	GBP	184.60	96'076.25	0.02	a)
GB0008847096	TESCO PLC	187'713	24'580	92'248	120'045	GBP	205.90	332'032.29	0.07	a)
GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	6'994	2'299	7'059	2'234	GBP	1'394.00	41'833.66	0.01	a)
GB0009697037	BABCOCK INTL GROUP PLC	0	18'525	18'525	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	662	0	662	0	GBP	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			31.03.2018					
GB0030646508	GKN PLC	94'593	7'584	102'177	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0030913577	BT GROUP PLC	98'858	155'654	107'739	146'773	GBP	227.50	448'546.50	0.09	a)
GB0031274896	MARKS & SPENCER GROUP PLC	35'520	10'566	0	46'086	GBP	270.20	167'276.24	0.04	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	0	40'206	0	40'206	GBP	206.50	111'529.77	0.02	a)
GB0033195214	KINGFISHER PLC	96'024	33'445	12'130	117'339	GBP	292.50	461'050.14	0.10	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	116'375	9'552	108'520	17'407	GBP	238.80	55'839.07	0.01	a)
GB00B01FLG62	G4S PLC	0	90'427	90'427	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	14'761	1'710	3'958	12'513	GBP	3'955.50	664'879.18	0.14	a)
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	13'091	5'208	0	18'299	GBP	1'661.00	408'297.65	0.09	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	
GB00BD3VFW73	CONVATEC GROUP PLC	26'048	0	26'048	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11'177	720	10'429	1'468	EUR	33.87	58'563.83	0.01	a)
GB00BDVZY77	ROYAL MAIL PLC	78'765	15'469	64'167	30'067	GBP	540.80	218'427.18	0.05	a)
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	296'164	56'532	56'503	296'193	GBP	194.22	772'767.11	0.16	a)
GB00BKKMKR23	RSA INSURANCE GROUP PLC	0	32'085	0	32'085	GBP	630.00	271'532.92	0.06	a)
GB00BVF7Q58	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	100'751	32'370	GBP	381.30	165'801.86	0.03	a)
JE00B4T3BW64	GLENCORE PLC	141'662	14'902	35'047	121'517	GBP	353.80	577'530.29	0.12	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	
GB								7'809'797.08	1.63	
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	33'364	12'753	13'175	32'942	EUR	7.11	275'838.19	0.06	a)
IE00BGH1M568	PERRIGO CO PLC	0	4'000	0	4'000	USD	83.34	319'225.54	0.07	a)
IE								595'063.73	0.13	
US83417M1045	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	0	1'595	1'595	0	USD	0.00	0.00	0.00	
IL								0.00	0.00	
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	34'135	32'427	34'135	32'427	EUR	2.95	112'792.07	0.02	a)
IT0000072626	INTESA SANPAOLO-RSP	103'494	17'457	47'469	73'482	EUR	3.08	266'369.46	0.06	a)
IT0003128367	ENEL SPA	52'732	21'760	4'721	69'771	EUR	4.97	408'381.60	0.09	a)
IT0003132476	ENI SPA	35'048	4'137	14'360	24'825	EUR	14.29	417'729.87	0.09	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	51'356	262'230	EUR	0.77	238'106.68	0.05	a)
IT0003497176	TELECOM ITALIA-RSP	146'241	41'273	34'481	153'033	EUR	0.68	121'905.56	0.03	a)
IT0005239360	UNICREDIT SPA	0	1'710	1'710	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT								1'565'285.24	0.34	
JP3040890000	JAPAN PRIME REALTY INVESTMEN	0	62	62	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3102000001	AISIN SEIKI CO LTD	5'900	2'000	0	7'900	JPY	5'780.00	411'151.15	0.09	a)
JP3111200006	ASAHI KASEI CORP	8'000	26'900	2'600	32'300	JPY	1'399.00	406'880.44	0.09	a)
JP3112000009	ASAHI GLASS CO LTD	9'200	2'400	0	11'600	JPY	4'405.00	460'098.14	0.10	a)
JP3116000005	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	0	5'400	2'200	3'200	JPY	5'667.00	163'286.31	0.03	a)
JP3122800000	AMADA HOLDINGS CO LTD	6'300	7'000	6'300	7'000	JPY	1'292.00	81'434.26	0.02	a)
JP3126340003	ALFREDA HOLDINGS CORP	4'600	1'500	0	6'100	JPY	2'368.00	130'064.30	0.03	a)
JP3131090007	IIDA GROUP HOLDINGS CO LTD	0	21'300	1'800	19'500	JPY	1'988.00	349'057.98	0.07	a)
JP3143600009	ITOCHU CORP	11'300	27'400	2'500	36'200	JPY	2'066.50	673'582.13	0.14	a)
JP3164800009	NOK CORP	2'000	3'500	0	5'500	JPY	2'066.00	102'315.07	0.02	a)
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	5'800	0	5'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165700000	NTT DATA CORP	0	47'400	0	47'400	JPY	1'132.00	483'138.17	0.10	a)
JP3174410005	OJI HOLDINGS CORP	0	65'000	7'000	58'000	JPY	684.00	357'215.81	0.07	a)
JP3190000004	OBAYASHI CORP	20'300	24'200	0	44'500	JPY	1'164.00	466'401.11	0.10	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	0	1'700	JPY	6'260.00	95'823.02	0.02	a)
JP3200450009	ORIX CORP	0	36'500	34'500	2'000	JPY	1'876.50	33'792.88	0.01	a)
JP3210200006	KAJIMA CORP	24'000	10'000	3'000	31'000	JPY	987.00	275'502.43	0.06	a)
JP3242800005	CANON INC	5'000	24'000	8'900	20'100	JPY	3'853.00	697'335.29	0.15	a)
JP3249600002	KYOCERA CORP	0	2'000	0	2'000	JPY	6'004.00	108'122.79	0.02	a)
JP3256000005	KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD	0	17'300	0	17'300	JPY	2'337.00	364'041.92	0.08	a)
JP3268950007	MEDIPAL HOLDINGS CORP	5'600	3'100	0	8'700	JPY	2'180.00	170'774.23	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	

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			31.03.2018					
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	0	9'800	JPY	1'576.00	139'068.53	0.03	a)
JP3293200006	COCA-COLA BOTTLERS JAPAN HOL	0	7'900	0	7'900	JPY	4'395.00	312'631.37	0.07	a)
JP3351200005	SHIZUOKA BANK LTD/THE	0	51'000	51'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3358800005	SHIMIZU CORP	37'800	10'900	0	48'700	JPY	951.00	417'019.21	0.09	a)
JP3366800005	SHOWA SHELL SEKIYU KK	38'700	5'200	4'700	39'200	JPY	1'441.00	508'623.74	0.11	a)
JP3386030005	JFE HOLDINGS INC	0	23'300	0	23'300	JPY	2'143.50	449'703.21	0.09	a)
JP3386380004	J FRONT RETAILING CO LTD	0	5'400	0	5'400	JPY	1'809.00	87'958.72	0.02	a)
JP3386450005	JXTG HOLDINGS INC	70'500	27'900	7'300	91'100	JPY	643.70	528'017.68	0.11	a)
JP3388200002	AEON CO LTD	11'700	16'100	5'400	22'400	JPY	1'899.50	383'119.18	0.08	a)
JP3397200001	SUZUKI MOTOR CORP	9'400	1'600	0	11'000	JPY	5'730.00	567'536.62	0.12	a)
JP3399400005	STANLEY ELECTRIC CO LTD	1'200	3'100	0	4'300	JPY	3'930.00	152'162.48	0.03	a)
JP3404200002	SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES	11'000	17'800	0	28'800	JPY	1'952.00	506'196.20	0.11	a)
JP3404600003	SUMITOMO CORP	19'600	21'100	3'400	37'300	JPY	1'791.00	601'521.28	0.13	a)
JP3419050004	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	0	4'300	0	4'300	JPY	1'685.00	65'240.15	0.01	a)
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	13'500	3'500	17'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3429800000	ANA HOLDINGS INC	12'300	800	13'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3435000009	SONY CORP	0	700	0	700	JPY	5'146.00	32'435.04	0.01	a)
JP3435350008	SONY FINANCIAL HOLDINGS INC	0	12'800	0	12'800	JPY	1'936.00	223'132.02	0.05	a)
JP3436100006	SOFTBANK GROUP CORP	0	900	900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3443600006	TAISEI CORP	8'200	0	8'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3456000003	TAKASHIMAYA CO LTD	30'000	10'000	0	40'000	JPY	1'021.00	367'732.75	0.08	a)
JP3476480003	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	0	8'300	0	8'300	JPY	1'942.50	145'172.95	0.03	a)
JP3493800001	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	18'500	5'200	1'200	22'500	JPY	2'198.00	445'304.19	0.09	a)
JP3526600006	CHUBU ELECTRIC POWER CO INC	0	6'900	0	6'900	JPY	1'503.00	93'380.17	0.02	a)
JP3539220008	T&D HOLDINGS INC	6'900	3'000	0	9'900	JPY	1'688.50	150'516.06	0.03	a)
JP3546800008	TERUMO CORP	0	1'400	0	1'400	JPY	5'590.00	70'467.10	0.01	a)
JP3551500006	DENSO CORP	8'300	3'400	400	11'300	JPY	5'820.00	592'172.19	0.12	a)
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	0	800	0	800	JPY	20'015.00	144'175.73	0.03	a)
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	12'600	0	12'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3592200004	TOSHIBA CORP	0	46'000	0	46'000	JPY	308.00	127'571.93	0.03	a)
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	4'194	7'000	0	11'194	JPY	6'825.00	687'914.62	0.14	a)
JP3651210001	NABTESCO CORP	0	5'709	5'709	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3657400002	NIKON CORP	14'000	6'700	1'400	19'300	JPY	1'896.00	329'489.99	0.07	a)
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	0	1'400	JPY	5'060.00	63'785.97	0.01	a)
JP3729400006	NIPPON EXPRESS CO LTD	6'400	500	6'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
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	2'900	0	2'900	JPY	4'900.00	127'950.11	0.03	a)
JP3738600000	NGK SPARK PLUG CO LTD	0	1'800	0	1'800	JPY	2'563.00	41'540.11	0.01	a)
JP3753000003	NIPPON YUSEN KK	11'000	0	11'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3756600007	NINTENDO CO LTD	0	300	0	300	JPY	46'860.00	126'581.47	0.03	a)
JP3758190007	NEXON CO LTD	0	22'500	7'500	15'000	JPY	1'760.00	237'711.67	0.05	a)
JP3762600009	NOMURA HOLDINGS INC	0	9'200	0	9'200	JPY	615.30	50'970.79	0.01	a)
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	0	22'100	0	22'100	JPY	2'512.00	499'871.63	0.10	a)
JP3785000005	HITACHI CHEMICAL CO LTD	0	8'100	8'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3788600009	HITACHI LTD	0	22'000	0	22'000	JPY	770.80	152'690.13	0.03	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	0	800	JPY	8'960.00	64'542.32	0.01	a)
JP3805010000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	58'000	39'000	0	97'000	JPY	573.00	500'464.11	0.10	a)
JP3814000000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	0	12'600	0	12'600	JPY	4'245.00	481'609.25	0.10	a)
JP3818000006	FUJITSU LTD	33'000	8'000	0	41'000	JPY	654.80	241'734.76	0.05	a)
JP3820000002	FUJI ELECTRIC CO LTD	18'000	54'000	0	72'000	JPY	724.00	469'372.50	0.10	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	0	1'100	JPY	3'660.00	36'251.03	0.01	a)
JP3866800000	PANASONIC CORP	19'400	10'900	0	30'300	JPY	1'521.00	414'971.65	0.09	a)
JP3877600001	MARUBENI CORP	32'200	9'500	0	41'700	JPY	769.90	289'079.27	0.06	a)
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	13'800	2'600	14'800	1'600	JPY	3'355.00	48'334.71	0.01	a)
JP3893600001	mitsui & co ltd	33'400	2'300	35'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3897700005	mitsubishi chemical holdings	53'700	9'400	7'600	55'500	JPY	1'030.50	514'976.68	0.11	a)
JP3899800001	mitsubishi motors corp	6'300	25'000	0	31'300	JPY	761.00	214'474.46	0.04	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			31.03.2018					
JP3902400005	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	15'800	6'000	0	21'800	JPY	1'701.50	333'991.20	0.07	a)
JP3902900004	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	114'100	54'900	121'800	47'200	JPY	697.00	296'224.76	0.06	a)
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	0	2'200	2'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3935600001	YAMAZAKI BAKING CO LTD	24'100	1'700	25'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3939000000	YAMADA DENKI CO LTD	0	35'700	0	35'700	JPY	638.00	205'085.75	0.04	a)
JP3951600000	UNICHARM CORP	0	14'500	0	14'500	JPY	3'029.00	395'470.28	0.08	a)
JP3973400009	RICOH CO LTD	0	19'700	0	19'700	JPY	1'051.00	186'429.88	0.04	a)
JP3982800009	ROHM CO LTD	2'700	1'300	300	3'700	JPY	10'130.00	337'487.54	0.07	a)
JP								20'289'882.57	4.26	
LU0061462528	RTL GROUP	3'971	1'320	0	5'291	EUR	67.45	420'295.32	0.09	a)
LU1598757687	ARCELORMITTAL	0	6'733	0	6'733	EUR	25.70	203'787.04	0.04	a)
LU								624'082.36	0.13	
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	8'323	999	0	9'322	EUR	2'547.60	279'688.72	0.06	a)
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	52'941	4'467	28'021	29'387	GBP	2'233.50	881'700.54	0.18	a)
NL0000008977	HEINEKEN HOLDING NV	0	9'952	4'236	5'716	EUR	83.70	563'446.27	0.12	a)
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	9'192	7'467	7'743	8'916	EUR	2.44	25'589.42	0.01	a)
NL0000009355	UNILEVER NV-CVA	14'972	1'714	11'668	5'018	EUR	45.87	271'077.97	0.06	a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	0	7'079	0	7'079	EUR	53.42	445'359.41	0.09	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	1'336	446	252	1'530	USD	117.00	171'419.98	0.04	a)
NL0010773842	NN GROUP NV	0	9'849	9'849	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	29'829	3'571	4'193	29'207	EUR	19.24	661'868.93	0.14	a)
NL								3'300'151.24	0.70	
PTEDP0AM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	7'508	15'640	0	23'148	EUR	3.09	84'183.23	0.02	a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	3'697	0	3'697	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
PT								84'183.23	0.02	
BMG169621056	BUNGE LTD	1'548	0	1'548	0	USD	0.00	0.00	0.00	
IE00B58JVZ52	SEAGATE TECHNOLOGY	0	1'254	0	1'254	USD	58.52	70'272.60	0.01	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	5'956	383	6'339	0	USD	0.00	0.00	0.00	
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	1'164	0	1'164	0	USD	0.00	0.00	0.00	
NL0011031208	MYLAN NV	0	1'013	0	1'013	USD	41.17	39'936.91	0.01	a)
PA1436583006	CARNIVAL CORP	4'261	4'108	2'441	5'928	USD	65.58	372'274.89	0.08	a)
SG9999000020	FLEX LTD	0	3'298	0	3'298	USD	16.33	51'572.83	0.01	a)
US0010551028	AFLAC INC	3'796	17'551	8'151	13'196	USD	43.76	552'972.78	0.12	a)
US00130H1059	AES CORP	37'979	11'923	0	49'902	USD	11.37	543'328.58	0.11	a)
US00206R1023	AT&T INC	0	1'969	0	1'969	USD	35.65	67'218.59	0.01	a)
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	11'026	1'772	981	11'817	USD	59.92	678'052.28	0.14	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	3'358	2'259	0	5'617	USD	94.65	509'107.13	0.11	a)
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	4'191	0	4'191	USD	70.98	284'864.15	0.06	a)
US0126531013	ALBEMARLE CORP	0	839	839	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0200021014	ALLSTATE CORP	5'194	703	282	5'615	USD	94.80	509'732.40	0.11	a)
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	295	511	361	445	USD	1'031.79	439'678.74	0.09	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	243	60	22	281	USD	1'037.14	279'079.44	0.06	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	193	213	25	381	USD	1'447.34	528'055.63	0.11	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	3'813	462	3'212	1'063	USD	145.34	147'945.77	0.03	a)
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	130	2'695	USD	219.70	566'986.82	0.12	a)
US0378331005	APPLE INC	11'084	934	5'735	6'283	USD	167.78	1'009'465.28	0.21	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	10'719	1'141	1'027	10'833	USD	55.61	576'880.39	0.12	a)
US03965L1008	ARCONIC INC	7'160	2'276	0	9'436	USD	23.04	208'187.45	0.04	a)
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	
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	31'237	34'931	32'737	33'431	USD	29.99	960'085.63	0.20	a)
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	7'485	1'448	367	8'566	USD	65.04	533'510.22	0.11	a)
US0758871091	BECTON DICKINSON AND CO	388	2'728	388	2'728	USD	216.70	566'092.52	0.12	a)
US0846707026	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0	587	587	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			31.03.2018					
US0865161014	BEST BUY CO INC	7'203	2'154	1'412	7'945	USD	69.99	532'493.16	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	292	463	2'438	USD	327.88	765'478.09	0.16	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	
US12503M1080	CBOE GLOBAL MARKETS INC	4'223	287	4'510	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	0	4'846	0	4'846	USD	47.22	219'125.81	0.05	a)
US1255091092	CIGNA CORP	2'605	282	0	2'887	USD	167.74	463'732.53	0.10	a)
US1266501006	CVS HEALTH CORP	7'023	1'779	401	8'401	USD	62.21	500'466.86	0.10	a)
US1331311027	CAMDEN PROPERTY TRUST	0	1'258	1'258	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	0	6'125	0	6'125	USD	95.82	562'013.05	0.12	a)
US1510201049	CELGENE CORP	0	706	706	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US15135B1017	CENTENE CORP	2'541	1'051	0	3'592	USD	106.87	367'600.65	0.08	a)
US1567001060	CENTURYLINK INC	18'620	1'857	20'477	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US1667641005	CHEVRON CORP	0	817	329	488	USD	114.04	53'291.90	0.01	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	21'230	3'512	4'254	20'488	USD	42.89	841'472.15	0.18	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	10'794	1'170	7'964	4'000	USD	67.50	258'552.00	0.05	a)
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	7'498	0	7'498	USD	80.50	577'996.83	0.12	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	19'168	5'099	24'267	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2003401070	COMERICA INC	0	3'244	0	3'244	USD	95.93	298'002.17	0.06	a)
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	0	7'402	0	7'402	USD	59.29	420'256.72	0.09	a)
US2193501051	CORNING INC	11'109	0	11'109	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US23355L1061	DXC TECHNOLOGY CO	5'719	998	1'110	5'607	USD	100.53	539'772.03	0.11	a)
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	5'172	371	5'057	486	USD	85.25	39'674.80	0.01	a)
US2473617023	DELTA AIR LINES INC	6'090	2'163	0	8'253	USD	54.81	433'167.42	0.09	a)
US2566771059	DOLLAR GENERAL CORP	0	1'565	0	1'565	USD	93.55	140'198.15	0.03	a)
US26078J1007	DOWDUPONT INC	2'060	762	818	2'004	USD	63.71	122'261.43	0.03	a)
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	1'454	0	1'454	USD	68.30	95'097.53	0.02	a)
US30161N1019	EXELON CORP	2'175	12'265	1'407	13'033	USD	39.01	486'860.44	0.10	a)
US30219G1085	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	4'832	2'149	0	6'981	USD	69.08	461'800.19	0.10	a)
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	1'349	0	758	591	USD	74.61	42'224.90	0.01	a)
US30303M1027	FACEBOOK INC-A	1'213	367	356	1'224	USD	159.79	187'290.24	0.04	a)
US3377381088	FISERV INC	0	3'412	0	3'412	USD	71.31	232'993.39	0.05	a)
US3379321074	FIRSTENERGY CORP	0	10'896	10'896	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US35671D8570	FREIGHT-MCMORAN INC	3'559	1'660	0	5'219	USD	17.57	87'809.84	0.02	a)
US3647601083	GAP INC/THE	15'190	2'117	1'316	15'991	USD	31.20	477'765.03	0.10	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	0	723	723	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US40414L1098	HCP INC	1'726	0	1'726	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US40434L1052	HP INC	24'710	1'646	20'372	5'984	USD	21.92	125'607.70	0.03	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	17.54	115'491.39	0.02	a)
US4361061082	HOLLYFRONTIER CORP	905	0	0	905	USD	48.86	42'343.44	0.01	a)
US4370761029	HOME DEPOT INC	0	838	518	320	USD	178.24	54'618.44	0.01	a)
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	23'924	6'735	1'305	29'354	USD	18.64	523'959.04	0.11	a)
US4448591028	HUMANA INC	0	122	122	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	17'760	7'622	0	25'382	USD	15.10	367'017.63	0.08	a)
US44919P5089	IAC/INTERACTIVECORP	0	2'526	0	2'526	USD	156.38	378'267.21	0.08	a)
US45167R1041	IDEX CORP	0	400	400	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	16'579	3'474	886	19'167	USD	52.08	955'892.94	0.20	a)
US46266C1053	IQVIA HOLDINGS INC	0	3'140	277	2'863	USD	98.11	268'979.24	0.06	a)
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	8'854	9'035	784	17'105	USD	32.86	538'238.52	0.11	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	885	813	276	1'422	USD	109.97	149'746.94	0.03	a)
US4698141078	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	0	5'706	0	5'706	USD	59.15	323'199.48	0.07	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	6'126	1'902	4'548	3'480	USD	128.15	427'053.21	0.09	a)
US48020Q1076	JONES LANG LASALLE INC	0	531	0	531	USD	174.64	88'801.93	0.02	a)
US4932671088	KEYCORP	8'471	0	8'471	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			31.03.2018					
US4990491049	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	0	14'597	4'057	10'540	USD	46.01	464'383.72	0.10	a)
US5002551043	KOHL'S CORP	4'095	7'399	5'658	5'836	USD	65.51	366'106.15	0.08	a)
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	2'178	0	2'178	USD	161.75	337'354.34	0.07	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	2'830	492	667	2'655	USD	203.16	516'519.67	0.11	a)
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	0	8'030	0	8'030	USD	71.90	552'877.06	0.12	a)
US5218652049	LEAR CORP	0	1'488	1'488	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5253271028	LEIDOS HOLDINGS INC	7'553	969	422	8'100	USD	65.40	507'279.02	0.11	a)
US5272881047	LEUCADIA NATIONAL CORP	16'294	3'713	0	20'007	USD	22.73	435'477.32	0.09	a)
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	833	0	3'166	USD	140.87	427'084.26	0.09	a)
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	3'202	0	3'202	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US59156R1086	METLIFE INC	4'686	546	5'232	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5949181045	MICROSOFT CORP	9'779	3'694	462	13'011	USD	91.27	1'137'163.38	0.24	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	3'442	3'907	3'077	4'272	USD	52.14	213'297.82	0.04	a)
US6153691059	MOODY'S CORP	0	1'250	1'250	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6200763075	MOTOROLA SOLUTIONS INC	0	5'166	0	5'166	USD	105.30	520'915.06	0.11	a)
US64110D1046	NETAPP INC	0	9'120	7'679	1'441	USD	61.69	85'126.13	0.02	a)
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	32'475	6'139	5'665	32'949	USD	15.80	498'521.01	0.10	a)
US6703461052	NUCOR CORP	512	0	512	0	USD	0.00	0.00	0.00	
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	1'575	0	1'922	USD	151.43	278'708.01	0.06	a)
US6937181088	PACCAR INC	5'900	2'405	413	7'892	USD	66.17	500'071.78	0.10	a)
US6974351057	PALO ALTO NETWORKS INC	0	385	385	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7043261079	PAYCHEX INC	0	1'754	0	1'754	USD	61.59	103'448.44	0.02	a)
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	1'124	1'147	2'271	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7127041058	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	0	10'564	0	10'564	USD	18.66	188'766.17	0.04	a)
US7134481081	PEPSICO INC	2'853	250	3'103	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7170811035	PFIZER INC	16'452	7'991	0	24'443	USD	35.49	830'700.83	0.17	a)
US72651A2078	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	0	1'958	1'958	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7392761034	POWER INTEGRATIONS INC	0	611	611	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US74251V1026	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	6'624	932	0	7'556	USD	60.91	440'721.96	0.09	a)
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	0	513	513	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7433151039	PROGRESSIVE CORP	10'031	1'178	1'568	9'641	USD	60.93	562'519.26	0.12	a)
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	4'794	2'046	5'103	1'737	USD	100.30	166'834.13	0.04	a)
US74876Y1010	QUINTILES IMS HOLDINGS INC	2'015	277	2'292	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7512121010	RALPH LAUREN CORP	0	325	0	325	USD	111.80	34'794.40	0.01	a)
US7593516047	REINSURANCE GROUP OF AMERICA	0	3'410	0	3'410	USD	154.00	502'874.06	0.11	a)
US7841171033	SEI INVESTMENTS COMPANY	0	6'184	0	6'184	USD	74.91	443'601.92	0.09	a)
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	
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	841	9'392	USD	59.96	539'267.00	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	0	1'036	USD	97.78	97'004.96	0.02	a)
US87612E1064	TARGET CORP	0	3'287	0	3'287	USD	69.43	218'540.03	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	3'312	3'183	USD	73.19	223'086.11	0.05	a)
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	752	494	4'002	USD	214.00	820'115.45	0.17	a)
US9139031002	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2'785	707	3'076	416	USD	118.41	47'170.00	0.01	a)
US91529Y1064	UNUM GROUP	0	2'639	0	2'639	USD	47.61	120'315.54	0.03	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	6.96	446'714.65	0.09	a)
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	0	557	0	557	USD	119.62	63'803.30	0.01	a)
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	4'125	531	310	4'346	USD	121.27	504'692.95	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			31.03.2018					
US9290891004	VOYA FINANCIAL INC	0	11'648	976	10'672	USD	50.50	516'085.11	0.11	a)
US9311421039	WALMART INC	7'975	1'212	1'146	8'041	USD	88.97	685'074.48	0.14	a)
US9314271084	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	6'940	1'871	0	8'811	USD	65.47	552'397.47	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	
US96145D1054	WESTROCK CO	7'419	894	0	8'313	USD	64.17	510'827.13	0.11	a)
US9633201069	WHIRLPOOL CORP	0	252	252	0	USD	0.00	0.00	0.00	
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 BANCORPORATION	0	5'063	0	5'063	USD	52.73	255'652.38	0.05	a)
US								38'777'807.91	8.15	
GB00B17BBQ50	INVESTEC PLC	11'960	0	11'960	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
ZA								0.00	0.00	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte								182'219'033.65	38.22	
AU0000QBCHF5	6.5000 % Q 6 1/2 07/12/21 MTN	1'000	0	0	1'000	AUD	111.59%	819'622.04	0.17	a)
AU000XQLQAB5	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/28 28	0	1'500	0	1'500	AUD	100.85%	1'111'155.84	0.23	a)
AU3CB0216141	5.2500 % BNG 5 1/4 05/20/24 MTN	500	0	0	500	AUD	112.63%	413'637.91	0.09	a)
AU3CB0224046	4.7500 % MET 4 3/4 09/17/21 AMTN	0	100	0	100	AUD	105.47%	77'474.24	0.02	a)
AU3CB0236263	4.0000 % CS 4 03/09/21 MTN	500	100	0	600	AUD	102.91%	453'527.87	0.10	a)
AU3CB0239085	2.2500 % LBANK 2 1/4 02/17/21 MTN	1'000	100	0	1'100	AUD	98.95%	799'504.08	0.17	a)
AU3CB0242147	3.5000 % WSTP 3 1/2 02/07/22 MTN	1'000	100	0	1'100	AUD	101.79%	822'442.63	0.17	a)
AU3CB0244960	3.5000 % LHNXX 3 1/2 06/16/22 MTN	440	0	0	440	AUD	101.29%	327'348.16	0.07	a)
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	0	820	0	820	AUD	100.14%	603'167.49	0.13	a)
AU3FN0037495	2.9850 % VZ 0 02/17/23 MTN	0	60	0	60	AUD	100.74%	44'399.52	0.01	a)
AU3SG0001522	2.7500 % WATC 2 3/4 10/20/22 22	0	1'000	0	1'000	AUD	100.52%	738'368.66	0.15	a)
AU3SG0001639	2.5000 % WATC 2 1/2 07/23/24 24	0	2'000	0	2'000	AUD	97.70%	1'435'324.68	0.30	a)
XS1014094061	5.0000 % NAB 5 01/17/20 GMTN	0	100	0	100	AUD	104.12%	76'476.76	0.02	a)
XS1074107910	4.7500 % EIBKOR 4 3/4 06/03/21 EMTN	500	0	0	500	AUD	104.09%	382'288.31	0.08	a)
XS1094768469	4.2500 % CCLAU 4 1/4 08/12/21 EMTN	0	500	0	500	AUD	103.73%	380'969.82	0.08	a)
XS1602259985	3.5000 % CCLAU 3 1/2 04/26/24 EMTN	0	500	0	500	AUD	100.53%	369'221.05	0.08	a)
AUD								8'854'929.06	1.87	
CA045167CR29	2.2500 % ASIA 2 1/4 09/16/21 GMTN	0	200	200	0	CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA060505FG45	3.4070 % BAC 3.407 09/20/25 MPLE	0	1'000	0	1'000	CAD	100.50%	746'486.06	0.16	a)
CA13509PFC29	1.2500 % CANHOU 1 1/4 12/15/20	0	100	100	0	CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA36158ZBV72	4.6000 % GE 4.6 01/26/22 MTN	700	0	0	700	CAD	106.17%	552'030.68	0.12	a)
CA40427HRV73	3.5580 % HSBC 3.558 10/04/17 DPNT	500	0	500	0	CAD	0.00%	0.00	0.00	
CA563469UJ24	2.5500 % MP 2.55 06/02/26	1'000	200	0	1'200	CAD	98.55%	878'349.27	0.18	a)
CA626209JG63	4.8750 % BCMFA 4 7/8 06/03/19	400	0	0	400	CAD	103.54%	307'623.38	0.06	a)
CA669827FV45	4.1500 % NS 4.15 11/25/19	500	0	500	0	CAD	0.00%	0.00	0.00	
CAD								2'484'489.39	0.52	
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	3'000	180	0	3'180	CHF	139.95%	4'450'410.00	0.93	a)
CH0026791225	3.1250 % C 3 1/8 09/27/21 EMTN	1'500	100	0	1'600	CHF	110.70%	1'771'200.00	0.37	a)
CH0031226134	3.2500 % PSYPO 3 1/4 06/15/27 424	0	125	0	125	CHF	126.81%	158'512.50	0.03	a)
CH0031408112	3.2500 % ICO 3 1/4 06/28/24 EMTN	0	300	0	300	CHF	118.05%	354'150.00	0.07	a)
CH0103165020	3.0000 % ALPHSW 3 11/25/19	160	0	0	160	CHF	104.00%	166'400.00	0.03	a)
CH0109674470	2.6250 % AXPOS 2 5/8 02/26/20	2'000	0	0	2'000	CHF	104.20%	2'084'000.00	0.44	a)
CH0109674488	3.1250 % AXPOS 3 1/8 02/26/25	1'000	0	0	1'000	CHF	111.10%	1'111'000.00	0.23	a)
CH0112272783	2.1250 % ZKB 2 1/8 03/12/20 111	5'000	0	0	5'000	CHF	105.20%	5'260'000.00	1.10	a)
CH0122456756	2.0000 % ZKB 2 01/21/21 117	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0123575091	2.1250 % NRSKTO 2 1/8 02/14/20 EMTN	125	0	0	125	CHF	104.45%	130'562.50	0.03	a)
CH0124853604	2.6250 % SGSNVX 2 5/8 03/08/19	1'300	0	1'300	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0127513114	3.1250 % ABNAV 3 1/8 04/27/21 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	109.60%	2'192'000.00	0.46	a)
CH0133090636	2.8750 % ZURNVX 2 7/8 07/27/21 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	109.75%	1'097'500.00	0.23	a)
CH0136940282	2.2500 % ALPHSW 2 1/4 09/20/21	2'000	0	0	2'000	CHF	103.55%	2'071'000.00	0.43	a)
CH0144279061	1.3750 % PFZENT 1 3/8 12/15/21 417	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0180513183	1.6250 % ROSW 1 5/8 09/23/22	1'400	0	0	1'400	CHF	107.55%	1'505'700.00	0.32	a)
CH0182484110	1.6250 % ZKB 1 5/8 04/12/27 125	0	250	0	250	CHF	111.70%	279'250.00	0.06	a)
CH0185843023	2.6250 % GLENLN 2 5/8 12/03/18 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	101.97%	1'019'700.00	0.21	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			31.03.2018					
CH0187218901	3.0000 % LHN VX 3 11/22/22	0	200	0	200	CHF	112.05%	224'100.00	0.05	a)
CH0188098740	1.5000 % ZURNVX 1 1/2 06/25/19 EMTN	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0188295312	3.5000 % CLNVX 3 1/2 09/26/22	1'000	0	0	1'000	CHF	113.63%	1'136'270.00	0.24	a)
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	1'100	200	0	1'300	CHF	108.05%	1'404'650.00	0.29	a)
CH0199589588	1.1250 % PSHYPO 1 1/8 11/16/23 576	1'000	0	0	1'000	CHF	106.72%	1'067'200.00	0.22	a)
CH0200044771	1.5000 % NANTDR 1 1/2 02/15/21	500	1'000	0	1'500	CHF	102.80%	1'542'000.00	0.32	a)
CH0200044821	1.7500 % BALHOL 1 3/4 04/26/23	1'000	150	0	1'150	CHF	107.30%	1'233'950.00	0.26	a)
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	0	150	0	150	CHF	114.70%	172'050.00	0.04	a)
CH0204477241	2.2500 % BLDAU 2 1/4 02/20/20 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	104.00%	1'040'000.00	0.22	a)
CH0204567322	1.3750 % CAF 1 3/8 02/11/21 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	104.45%	1'044'500.00	0.22	a)
CH0204574914	2.1250 % GASSM 2 1/8 02/08/19 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	102.14%	1'021'400.00	0.21	a)
CH0205276725	1.5000 % BERN 1 1/2 05/15/29	500	0	0	500	CHF	112.55%	562'750.00	0.12	a)
CH0208580693	1.1250 % KBFRIB 1 1/8 03/28/23	1'000	0	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0209474631	1.7500 % LONNVX 1 3/4 04/10/19	1'300	0	0	1'300	CHF	101.85%	1'324'050.00	0.28	a)
CH0212184052	1.0000 % RELLN 1 12/18/18	0	500	0	500	CHF	100.86%	504'300.00	0.11	a)
CH0214925825	1.0000 % ENAG 1 12/14/18	200	0	0	200	CHF	100.27%	200'540.00	0.04	a)
CH0215650737	2.0000 % SPSNSW 2 10/21/20	500	0	0	500	CHF	104.80%	524'000.00	0.11	a)
CH0222760826	1.3750 % KBSCHW 1 3/8 09/24/21	1'000	0	0	1'000	CHF	105.85%	1'058'500.00	0.22	a)
CH0225173332	2.0000 % CAF 2 02/05/24 EMTN	500	0	0	500	CHF	110.70%	553'500.00	0.12	a)
CH0225941605	1.2500 % PFZENT 1 1/4 10/29/21 440	1'000	0	0	1'000	CHF	105.68%	1'056'800.00	0.22	a)
CH0229751927	2.5000 % BANBRA 2 1/2 06/20/19 EMTN	0	300	0	300	CHF	102.08%	306'240.00	0.06	a)
CH0234274493	1.7500 % SPSNSW 1 3/4 04/16/21	500	0	0	500	CHF	104.60%	523'000.00	0.11	a)
CH0236122724	1.3750 % SGSNVX 1 3/8 02/25/22	1'037	0	0	1'037	CHF	105.30%	1'091'961.00	0.23	a)
CH0240672227	1.6250 % SYN NVX 1 5/8 11/01/24	2'000	0	0	2'000	CHF	98.40%	1'968'000.00	0.41	a)
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	108.25%	1'623'750.00	0.34	a)
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449	1'000	0	0	1'000	CHF	106.36%	1'063'600.00	0.22	a)
CH0244830441	1.2500 % MIVIVI 1 1/4 06/13/18	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0245865834	1.0000 % NAB 1 12/10/21 GMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	103.95%	2'079'000.00	0.44	a)
CH0246920208	1.1250 % KBLUZE 1 1/8 06/30/23	1'000	0	0	1'000	CHF	106.20%	1'062'000.00	0.22	a)
CH0248259456	0.7500 % CS 0 3/4 07/11/19	1'000	200	1'200	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0254281634	1.0000 % ICBCAS 1 12/17/19	0	100	0	100	CHF	102.15%	102'150.00	0.02	a)
CH0255475276	0.0000 % LISNSW 0 10/06/17	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0260067779	1.5000 % CAF 1 1/2 12/01/28 EMTN	0	200	0	200	CHF	109.25%	218'500.00	0.05	a)
CH0261399064	1.1250 % BALHOL 1 1/8 12/19/24	0	500	0	500	CHF	104.25%	521'250.00	0.11	a)
CH0265801198	0.5500 % KBFRIB 0.55 02/03/25	2'000	0	0	2'000	CHF	102.75%	2'055'000.00	0.43	a)
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.65%	1'006'500.00	0.21	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	1'000	200	0	1'200	CHF	101.16%	1'213'920.00	0.25	a)
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	1'000	100	0	1'100	CHF	101.75%	1'119'250.00	0.23	a)
CH0273755824	0.2300 % SWIAL 2015-1 A	2'000	0	0	2'000	CHF	100.36%	2'007'280.00	0.42	a)
CH0273925989	0.6250 % DB 0 5/8 12/19/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	98.15%	1'963'000.00	0.41	a)
CH0274758827	0.6250 % MDLZ 0 5/8 12/30/21	0	200	0	200	CHF	101.75%	203'500.00	0.04	a)
CH0275352125	0.3750 % THURBK 0 3/8 03/31/25	2'000	200	0	2'200	CHF	101.55%	2'234'100.00	0.47	a)
CH0275527882	0.6250 % KBAARG 0 5/8 04/13/28	1'000	0	0	1'000	CHF	102.10%	1'021'000.00	0.21	a)
CH0276581110	0.1940 % CABEI 0.194 11/19/21 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.85%	1'008'500.00	0.21	a)
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	2'000	0	0	2'000	CHF	102.60%	2'052'000.00	0.43	a)
CH0278875940	0.6250 % FABUH 0 5/8 05/27/22	1'000	0	0	1'000	CHF	101.70%	1'017'000.00	0.21	a)
CH0278875965	0.2500 % BCICI 0 1/4 06/17/20	200	0	0	200	CHF	100.60%	201'200.00	0.04	a)
CH0282343760	0.4000 % WSTP 0.4 06/09/23 EMTN	500	100	0	600	CHF	101.30%	607'800.00	0.13	a)
CH0282526133	0.5000 % BCG 0 1/2 06/10/24	900	0	0	900	CHF	102.20%	919'800.00	0.19	a)
CH0282857926	0.3400 % SWICC 2015-2 A	2'000	2'000	2'000	2'000	CHF	100.55%	2'011'000.00	0.42	a)
CH0284087589	0.5000 % SGKNSW 0 1/2 06/24/25	0	1'000	0	1'000	CHF	102.50%	1'025'000.00	0.22	a)
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24	1'000	0	0	1'000	CHF	103.10%	1'031'000.00	0.22	a)
CH0297782952	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/21/23	0	1'000	0	1'000	CHF	104.20%	1'042'000.00	0.22	a)
CH0304055806	0.2000 % SWICA 2015-1 A	1'000	0	0	1'000	CHF	100.21%	1'002'060.00	0.21	a)
CH0304749218	1.5000 % KKWLEB 1 1/2 12/16/22	1'000	0	0	1'000	CHF	102.25%	1'022'500.00	0.21	a)
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	0	0	1'000	CHF	102.65%	1'026'500.00	0.22	a)
CH0307256401	0.0300 % ZKB 0.03 02/11/22 137	1'000	0	0	1'000	CHF	101.15%	1'011'500.00	0.21	a)
CH0307256427	0.2500 % PFZENT 0 1/4 02/11/28 475	2'000	100	0	2'100	CHF	98.75%	2'073'750.00	0.44	a)
CH0307256435	0.5000 % PSPNSW 0 1/2 02/16/24	1'000	0	0	1'000	CHF	101.40%	1'014'000.00	0.21	a)
CH0310451825	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 10/25/23 EMTN	0	200	0	200	CHF	100.50%	201'000.00	0.04	a)
CH0310451841	0.7500 % UBS 0 3/4 02/22/22	800	0	0	800	CHF	102.20%	817'600.00	0.17	a)
CH0311427584	0.5000 % HTHROW 0 1/2 05/17/24 EMTN	0	500	0	500	CHF	100.60%	503'000.00	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			31.03.2018					
CH0311427626	0.3710 % CABEI 0.371 08/26/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	101.35%	1'013'500.00	0.21	a)
CH0314209369	0.4100 % AMGN 0.41 03/08/23	1'000	0	0	1'000	CHF	101.15%	1'011'500.00	0.21	a)
CH0319403082	0.1500 % SWICA 2016-1 A	500	0	0	500	CHF	100.00%	500'000.00	0.10	a)
CH0323440104	0.3000 % SWICA 2016-2 A	500	0	0	500	CHF	100.60%	503'000.00	0.11	a)
CH0323735594	0.1500 % LLY 0.15 05/24/24 EMTN	400	0	0	400	CHF	99.95%	399'800.00	0.08	a)
CH0326371389	0.1300 % SWICC 2016-1 A	750	0	0	750	CHF	100.14%	751'050.00	0.16	a)
CH0327226863	0.6250 % TQLAU 0 5/8 06/23/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	101.90%	509'500.00	0.11	a)
CH0328298028	0.2200 % SWIAL 2016-1 A	200	200	200	200	CHF	100.25%	200'500.00	0.04	a)
CH0330049831	1.0000 % WPLAU 1 12/11/23 EMTN	500	0	0	500	CHF	103.45%	517'250.00	0.11	a)
CH0333827472	0.1250 % TEVA 0 1/8 07/27/18	615	200	0	815	CHF	99.88%	814'022.00	0.17	a)
CH0333827506	1.0000 % TEVA 1 07/28/25	1'445	0	0	1'445	CHF	83.20%	1'202'240.00	0.25	a)
CH0338330456	0.1700 % MCD 0.17 10/04/24 GMTN	440	0	0	440	CHF	99.10%	436'040.00	0.09	a)
CH0340912150	0.0100 % SOONVX 0.01 10/11/21	1'000	100	0	1'100	CHF	100.15%	1'101'650.00	0.23	a)
CH0340912168	0.6500 % TQLAU 0.65 11/02/26 EMTN	500	0	0	500	CHF	100.25%	501'250.00	0.11	a)
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	0	1'000	0	1'000	CHF	100.05%	1'000'500.00	0.21	a)
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	0	200	0	200	CHF	100.05%	200'100.00	0.04	a)
CH0357483210	0.1400 % SWMOB 2017-1 A	1'000	0	0	1'000	CHF	100.10%	1'001'000.00	0.21	a)
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.10%	991'000.00	0.21	a)
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	1'000	200	0	1'200	CHF	100.25%	1'203'000.00	0.25	a)
CH0358181219	0.7500 % DB 0 3/4 03/21/22 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	100.40%	1'004'000.00	0.21	a)
CH0359915409	0.4500 % ROSW 0.45 03/23/29 2029	0	200	0	200	CHF	98.90%	197'800.00	0.04	a)
CH0360172693	0.6170 % MDLZ 0.617 09/30/24	0	100	0	100	CHF	100.30%	100'300.00	0.02	a)
CH0361532820	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 494	0	1'000	0	1'000	CHF	99.56%	995'600.00	0.21	a)
CH0361532879	0.6250 % FHZNSW 0 5/8 05/24/29	1'000	0	0	1'000	CHF	100.20%	1'002'000.00	0.21	a)
CH0361532945	2.1250 % ZKB 2 1/8 PERP ..	500	0	0	500	CHF	102.45%	512'250.00	0.11	a)
CH0365501516	0.6250 % UBS 0 5/8 05/18/24 EMTN	1'000	200	0	1'200	CHF	101.10%	1'213'200.00	0.25	a)
CH0367206668	0.3750 % VZ 0 3/8 05/31/23 EMTN	1'000	200	0	1'200	CHF	100.50%	1'206'000.00	0.25	a)
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	1'500	300	0	1'800	CHF	101.25%	1'822'500.00	0.38	a)
CH0368825474	0.4000 % BFCM 0.4 12/19/25 EMTN	1'500	0	0	1'500	CHF	99.35%	1'490'250.00	0.31	a)
CH0370943620	0.2000 % FCACCH 0.2 07/24/20	700	0	0	700	CHF	100.40%	702'800.00	0.15	a)
CH0373476032	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 12/08/25 0	0	1'000	0	1'000	CHF	100.20%	1'002'000.00	0.21	a)
CH0373476123	1.0000 % SGKNSW 1 11/30/27	0	500	0	500	CHF	99.10%	495'500.00	0.10	a)
CH0373476594	0.2500 % PFZENT 0 1/4 05/26/27 MAR	0	1'000	1'000	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0379268672	0.5000 % GS 0 1/2 12/04/24 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.65%	996'500.00	0.21	a)
CH0379268763	0.3000 % ACAFP 0.3 04/18/24 EMTN	0	2'000	0	2'000	CHF	99.90%	1'998'000.00	0.42	a)
CH0379610972	0.6000 % BFCM 0.6 04/05/27 EMTN	1'000	0	0	1'000	CHF	99.75%	997'500.00	0.21	a)
CH0380360062	0.4500 % GLJGR 0.45 09/15/20	500	0	0	500	CHF	100.30%	501'500.00	0.11	a)
CH0387879056	0.3000 % WSTP 0.3 11/28/25 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	99.00%	990'000.00	0.21	a)
CH0398677747	0.3500 % ANZNZ 0.35 10/22/24 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	100.35%	1'003'500.00	0.21	a)
CH0398677754	2.8750 % CREAL 2 7/8 02/09/22	0	1'000	0	1'000	CHF	100.45%	1'004'500.00	0.21	a)
CH0401673980	0.6250 % EBIUH 0 5/8 02/09/23 EMTN	0	1'000	0	1'000	CHF	100.25%	1'002'500.00	0.21	a)
CH0401956815	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 FEB	0	1'000	1'000	0	CHF	0.00%	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	0.21	a)
CH0406415320	0.1200 % SWICAR 0.12 04/18/21 A	0	1'000	0	1'000	CHF	99.96%	999'560.00	0.21	a)
CH0407676383	0.2000 % NIDKBK 0.2 03/28/25	0	1'000	0	1'000	CHF	100.65%	1'006'500.00	0.21	a)
CH0407809760	0.3750 % GIVNVX 0 3/8 04/09/25	0	1'500	0	1'500	CHF	99.76%	1'496'400.00	0.31	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	0	1'000	0	1'000	CHF	100.10%	1'000'980.00	0.21	a)
CHF								121'890'198.00	25.51	
CH0343366842	1.2500 % CS 1 1/4 07/17/25 EMTN	0	100	0	100	EUR	99.58%	117'269.52	0.02	a)
ES00000126A4	1.8000 % SPGBEI 1.8 11/30/24	1'000	0	0	1'000	EUR	118.31%	1'415'815.88	0.30	a)
ES00000126B2	2.7500 % SPGB 2 3/4 10/31/24	400	0	0	400	EUR	114.46%	539'200.67	0.11	a)
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	300	0	0	300	EUR	138.57%	489'596.01	0.10	a)
ES0378641056	5.0000 % FADE 5 12/17/26	0	100	0	100	EUR	131.36%	154'700.37	0.03	a)
ES0378641288	0.6250 % FADE 0 5/8 03/17/22	0	100	0	100	EUR	102.33%	120'518.80	0.03	a)
PTOTESOE0013	2.2000 % PGB 2.2 10/17/22	1'000	0	0	1'000	EUR	108.79%	1'281'220.30	0.27	a)
PTOTEUOE0019	4.1250 % PGB 4 1/8 04/14/27	300	200	0	500	EUR	122.81%	723'143.40	0.15	a)
XS1075371986	2.1250 % KOREA 2 1/8 06/10/24	1'000	0	0	1'000	EUR	107.82%	1'269'808.38	0.27	a)
XS1315181708	2.7500 % PERU 2 3/4 01/30/26	450	550	0	1'000	EUR	109.13%	1'285'259.81	0.27	a)
XS1432493879	2.6250 % INDON 2 5/8 06/14/23 REGS	0	1'000	0	1'000	EUR	106.23%	1'251'059.39	0.26	a)
XS1439749281	1.1250 % TEVA 1 1/8 10/15/24	300	0	0	300	EUR	83.20%	293'950.49	0.06	a)
XS1750986744	1.1250 % ENELIM 1 1/8 09/16/26 EMTN	0	200	0	200	EUR	97.72%	230'179.19	0.05	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			31.03.2018					
EUR									9'171'722.21	1.92
FR0000486763	5.5000 % CFF 5 1/2 01/26/27 EMTN	321	0	0	321	GBP	129.56%	558'683.60	0.12	a)
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	1'000	0	0	1'000	GBP	119.69%	1'607'821.24	0.34	a)
XS0355738799	7.6250 % C 7 5/8 04/03/18 EMTN	500	0	0	500	GBP	100.08%	672'184.54	0.14	a)
XS0472503589	5.1250 % NAB 5 1/8 12/09/21 GMTN	0	200	0	200	GBP	112.29%	301'672.35	0.06	a)
XS0578264870	3.8750 % TOTAL 3 7/8 12/14/18 EMTN	1'200	0	0	1'200	GBP	102.06%	1'645'160.20	0.35	a)
XS0604380724	4.3250 % BPLN 4.325 12/10/18 EMTN	600	0	0	600	GBP	102.25%	824'119.55	0.17	a)
XS0616897616	5.1250 % SANUK 5 1/8 04/14/21 EMTN	1'100	0	0	1'100	GBP	111.15%	1'642'411.76	0.34	a)
XS1327014749	2.6250 % MET 2 5/8 12/05/22 GMTN	0	200	0	200	GBP	104.23%	280'039.50	0.06	a)
XS1730883961	1.0000 % NESNVX 1 06/11/21 EMTN	0	500	0	500	GBP	98.94%	664'561.19	0.14	a)
GBP									8'196'653.93	1.72
US00037BAB80	2.8750 % ABBNVX 2 7/8 05/08/22	1'500	0	0	1'500	USD	98.93%	1'421'001.81	0.30	a)
US00254EMN93	1.7500 % SEK 1 3/4 05/18/20	1'500	200	0	1'700	USD	98.36%	1'601'238.39	0.34	a)
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	600	0	600	USD	94.87%	545'073.58	0.11	a)
US05252BAN91	5.1000 % ANZ 5.1 01/13/20 REGS	0	200	0	200	USD	103.69%	198'592.83	0.04	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	100.04%	957'992.62	0.20	a)
US05957PAR73	6.0000 % BANBRA 6 01/22/20 REGS	0	200	0	200	USD	104.39%	199'927.73	0.04	a)
US06051GEH83	5.0000 % BAC 5 05/13/21 MTN	0	200	0	200	USD	105.33%	201'728.02	0.04	a)
US12189LAL53	3.0500 % BNSF 3.05 09/01/22	0	300	0	300	USD	99.76%	286'576.16	0.06	a)
US17275RBJ05	1.8500 % CSCO 1.85 09/20/21	0	50	0	50	USD	96.41%	46'161.59	0.01	a)
US172967JJ16	2.4000 % C 2.4 02/18/20	1'500	100	0	1'600	USD	98.84%	1'514'448.23	0.32	a)
US172967KK69	2.7000 % C 2.7 03/30/21	0	200	0	200	USD	98.55%	188'741.04	0.04	a)
US191216AR14	3.1500 % KO 3.15 11/15/20	1'000	0	0	1'000	USD	101.03%	967'501.58	0.20	a)
US21688AAE29	3.3750 % RABOBK 3 3/8 05/21/25 MTN	0	250	0	250	USD	98.62%	236'103.46	0.05	a)
US21986BSA46	4.3750 % CAF 4 3/8 06/15/22	1'150	0	0	1'150	USD	104.88%	1'154'936.46	0.24	a)
US225433AT80	3.8000 % CS 3.8 06/09/23	500	0	0	500	USD	100.25%	479'997.05	0.10	a)
US22546QAP28	3.6250 % CS 3 5/8 09/09/24 MTN	500	0	0	500	USD	99.60%	476'870.44	0.10	a)
US25215DAP42	1.8750 % DEXGRP 1 7/8 01/29/20 REGS	0	200	0	200	USD	98.68%	188'986.19	0.04	a)
US369604BH58	4.5000 % GE 4 1/2 03/11/44	500	0	0	500	USD	98.16%	470'009.23	0.10	a)
US404280AN99	4.0000 % HSBC 4 03/30/22	0	200	0	200	USD	102.41%	196'133.72	0.04	a)
US404280BF56	2.6500 % HSBC 2.65 01/05/22	1'000	200	0	1'200	USD	97.27%	1'117'703.06	0.23	a)
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	500	0	0	500	USD	111.27%	532'775.12	0.11	a)
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	500	100	0	600	USD	115.28%	662'358.51	0.14	a)
US46625HJT86	3.8750 % JPM 3 7/8 02/01/24	0	200	0	200	USD	101.52%	194'434.93	0.04	a)
US500769FH22	2.0000 % KFW 2 10/04/22	0	300	0	300	USD	96.87%	278'285.26	0.06	a)
US59156RAX61	4.7500 % MET 4 3/4 02/08/21	0	200	0	200	USD	104.23%	199'617.47	0.04	a)
US594918BA18	2.3750 % MSFT 2 3/8 02/12/22	0	200	0	200	USD	98.06%	187'804.51	0.04	a)
US742718EP07	2.7000 % PG 2.7 02/02/26	0	200	0	200	USD	95.62%	183'127.59	0.04	a)
US74432QCB95	2.3500 % PRU 2.35 08/15/19 MTN	0	200	0	200	USD	99.39%	190'359.39	0.04	a)
US857524AB80	5.0000 % POLAND 5 03/23/22	1'000	0	0	1'000	USD	107.02%	1'024'785.22	0.21	a)
US87973RAC43	2.3750 % TEMASE 2 3/8 01/23/23 REGS	1'250	0	1'250	0	USD	0.00%	0.00	0.00	
US87973RAD26	3.3750 % TEMASE 3 3/8 07/23/42 REGS	500	0	500	0	USD	0.00%	0.00	0.00	
US88032XAE40	2.9850 % TENCNT 2.985 01/19/23 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	97.55%	934'090.92	0.20	a)
US91911TAM53	4.3750 % VALEBZ 4 3/8 01/11/22	1'000	0	683	317	USD	102.41%	310'868.91	0.07	a)
USP06518AG23	6.0000 % BAHAMA 6 11/21/28 REGS	0	200	200	0	USD	0.00%	0.00	0.00	
USP1905CAE05	4.7500 % BRFSBZ 4 3/4 05/22/24 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	92.31%	883'912.68	0.19	a)
USP4949BAJ37	3.8750 % BIMBOA 3 7/8 06/27/24 REGS	1'000	700	0	1'700	USD	100.40%	1'634'447.80	0.34	a)
USP7088CTF33	5.3750 % NATURA 5 3/8 02/01/23 REGS	0	1'000	0	1'000	USD	99.99%	957'494.66	0.20	a)
USQ98229AM12	3.7000 % WPLAU 3.7 03/15/28 REGS	200	0	0	200	USD	97.03%	185'824.20	0.04	a)
USU75000BD74	3.3500 % ROSW 3.35 09/30/24 REGS	1'000	200	0	1'200	USD	100.50%	1'154'854.11	0.24	a)
USY5749LAA99	3.0430 % MALAYS 3.043 04/22/25 REGS	0	500	0	500	USD	98.13%	469'856.02	0.10	a)
XS0070553820	0.0000 % EIB 0 11/06/26	0	200	0	200	USD	77.05%	147'558.50	0.03	a)
XS0455643394	6.0000 % LHNXX 6 12/30/19 REGS	500	0	0	500	USD	104.53%	500'470.49	0.10	a)
XS0485991417	7.3750 % LITHUN 7 3/8 02/11/20 REGS	2'000	0	0	2'000	USD	108.30%	2'074'084.99	0.44	a)
XS0592582653	4.3750 % BNG 4 3/8 02/16/21 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	104.65%	1'002'109.25	0.21	a)
XS0938722666	4.1250 % GLENLN 4 1/8 05/30/23 REGS	1'000	0	0	1'000	USD	100.78%	965'059.70	0.20	a)
XS1041751980	2.5000 % ICBAS 2 1/2 11/21/17 EMTN	1'000	0	1'000	0	USD	0.00%	0.00	0.00	
XS1197036541	1.6250 % NEDWBK 1 5/8 03/04/20 REGS	0	200	0	200	USD	98.37%	188'390.56	0.04	a)
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	0	200	0	200	USD	95.05%	182'047.42	0.04	a)
XS1231116481	2.0000 % SWEDA 2 05/12/20	1'000	0	0	1'000	USD	98.37%	942'017.96	0.20	a)
XS1405781342	3.6250 % OMAN 3 5/8 06/15/21 REGS	300	0	0	300	USD	97.53%	280'172.69	0.06	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			31.03.2018					
XS1433450258	2.4750 % KBN 0 06/16/20 REGS	800	200	0	1'000	USD	100.66%	963'901.01	0.20	a)
XS1485745704	2.1250 % QNBK 2 1/8 09/07/21 EMTN	600	0	0	600	USD	94.89%	545'217.22	0.11	a)
XS1622312434	2.7500 % NTBKKK 2 3/4 05/30/22 REGS	500	0	0	500	USD	96.39%	461'510.53	0.10	a)
XS1711039591	2.7500 % SDBC 2 3/4 11/16/22 EMTN	0	1'000	0	1'000	USD	97.52%	933'880.25	0.20	a)
USD								31'621'041.06	6.63	
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	
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	
ES06735169B1	REPSOL SA-RTS	0	30'952	30'952	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	0	11'558	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
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								22'083'884.95	4.63	
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND IN	3'705	0	0	3'705	CHF	198.50	735'442.50	0.15	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	2'800	200	0	3'000	CHF	214.00	642'000.00	0.13	a)
CH0002782263	LA FONCIERE	650	6'500	650	6'500	CHF	107.00	695'500.00	0.15	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	2'600	0	0	2'600	CHF	264.00	686'400.00	0.14	a)
CH0002751413	SWISS RE IMMOPLUS	850	0	850	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0009778769	IMMOFONDS	2'520	0	0	2'520	CHF	435.00	1'096'200.00	0.23	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	13'310	0	0	13'310	CHF	196.00	2'608'760.00	0.55	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDEN	18'000	1'200	0	19'200	CHF	64.25	1'233'600.00	0.26	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDEN	7'195	3'400	0	10'595	CHF	99.15	1'050'494.25	0.22	a)
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MI.	36'480	3'000	0	39'480	CHF	112.50	4'441'500.00	0.93	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMEF	13'000	700	0	13'700	CHF	69.95	958'315.00	0.20	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	4'100	513	0	4'613	CHF	185.30	854'788.90	0.18	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTM	4'100	0	0	4'100	CHF	169.50	694'950.00	0.15	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDE	17'000	0	0	17'000	CHF	15.80	268'600.00	0.06	a)
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	1'335	1'800	0	3'135	CHF	139.90	438'586.50	0.09	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	12'566	0	0	12'566	CHF	135.50	1'702'693.00	0.36	a)
CH0037430946	SWC (CH) REAL ESTATE FUND IFCA FA	5'800	0	0	5'800	CHF	138.60	803'880.00	0.17	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	9'326	700	0	10'026	CHF	129.80	1'301'374.80	0.27	a)
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	2'000	2'000	0	4'000	CHF	136.80	547'200.00	0.11	a)
CH0192940390	UBS CH PROPTY DIRECT URBAN	0	8'000	0	8'000	CHF	12.45	99'600.00	0.02	a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	0	7'650	0	7'650	CHF	160.00	1'224'000.00	0.26	a)
CH								22'083'884.95	4.63	
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden								61'892'531.35	12.99	
Strukturierte Produkte								17'925'410.48	3.76	
CH0048232224	ZKB TRACKER-ZERTIFIKAT AUF Q-MA	104'144	118'698	0	222'842	CHF	80.44	17'925'410.48	3.76	a)
CH								17'925'410.48	3.76	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								43'967'120.87	9.22	
CH0019509238	SWC (CH) EF GLOBAL FINANCIALS AA C	11'051	0	0	11'051	CHF	888.59	9'819'808.09	2.06	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	
CH0039299513	SWC (CH) EF HQ SWITZERLAND NT CHF	3'966	0	3'966	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0117044971	SWC (CH) INDEX EF EMERGING MARK	107'837	0	0	107'837	CHF	127.39	13'736'870.16	2.88	a)
CH0269985369	BB ADAMANT GLOBAL GENERIKA GT C	6'647	0	0	6'647	CHF	99.67	662'506.49	0.14	a)
CH0269987407	BB ADAMANT GLOBAL MEDTECH UND	13'402	0	0	13'402	CHF	145.38	1'948'382.76	0.41	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			31.03.2018					
CH0269987431	BB ADAMANT GLOBAL BIOTECH GT CH	6'505	0	0	6'505	CHF	93.70	609'518.50	0.13	a)
CH0388442359	SWC (CH) EF SMC SWITZERLAND (II) NT	0	123'706	0	123'706	CHF	98.61	12'198'624.20	2.56	a)
CH								38'975'710.20	8.18	
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	12'514	0	0	12'514	USD	268.29	3'215'041.29	0.67	a)
LU0555020998	NN L-EM MK DB HC-IC	237	0	0	237	USD	7'813.68	1'776'369.38	0.37	a)
LU0637847533	LACUNA SICAV-ASIA PACIF HE-I	366	0	366	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
LU0866272569	SWC (LU) EF GREEN INVEST EMERGING	0	12'713	12'713	0	USD	0.00	0.00	0.00	
LU								4'991'410.67	1.04	

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 **-206'474.92** **-0.04**

Futures **45'021.15** **0.01**

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	50	0	50	JPY	10.00	45'021.15	0.01	a)
06/18 S&P 500 EMINI FUT JUN18	0	22	15	7	USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/18 MINI MSCI EMG MKT JUN18	0	243	0	243	USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/18 S&P/TSX 60 IX FUT JUN18	0	64	73	-9	CAD	0.00	0.00	0.00	a)
06/18 ASX SPI 200 INDEX JUN18	0	0	2	-2	AUD	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	105	288	-183	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/18 SWISS MKT IX FUTR JUN18	0	204	8	196	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/18 SWISS MID CAP FUT JUN18	0	72	0	72	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/18 FTSE 100 IDX FUT JUN18	0	0	61	-61	GBP	0.00	0.00	0.00	a)
03/18 FTSE 100 IDX FUT MAR18	0	139	139	0	GBP	0.00	0.00	0.00	

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	

		Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
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	
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	

		Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
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	40'099.20	0.01	b)
CAD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	3'247'696	CAD	4'440'000	-44'708.17	-0.01	b)
EUR/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	14'237'067	EUR	12'190'000	-114'811.06	-0.02	b)
GBP/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	14'707'623	GBP	11'030'000	-94'948.12	-0.02	b)
USD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	1'724'169	USD	1'825'000	-20'195.93	0.00	b)
CHF/JPY	Verfall 27.04.2018	JPY	888'700'000	CHF	8'017'878	-20'502.54	0.00	b)
HKD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	542'214	HKD	4'500'000	-6'149.49	0.00	b)
NOK/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	109'463	NOK	900'000	-177.24	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	808'696	JPY	90'000'000	-1'212.47	0.00	b)
CHF/NOK	Verfall 27.04.2018	NOK	900'000	CHF	109'406	234.88	0.00	b)
CHF/EUR	Verfall 27.04.2018	EUR	4'800'000	CHF	5'652'624	-1'379.78	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	11'355'145	AUD	15'500'000	-6'225.43	0.00	b)
CHF/USD	Verfall 27.04.2018	USD	10'000'000	CHF	9'546'500	11'602.25	0.00	b)
CHF/GBP	Verfall 27.04.2018	GBP	7'300'000	CHF	9'804'849	-8'086.57	0.00	b)
CHF/CAD	Verfall 27.04.2018	CAD	12'000'000	CHF	8'883'360	14'964.40	0.00	b)
Devisentermingeschäfte						-251'496.07	-0.05	

Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht	36'118'378.47	7.58
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	154'404'208.26	32.39
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	182'219'033.65	38.22
Strukturierte Produkte	17'925'410.48	3.76
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	66'051'005.82	13.86
Andere Anlagen - Metallkonten	17'893'850.30	3.75
Derivative Finanzinstrumente	-206'474.92	-0.04
Sonstige Vermögenswerte	2'280'891.57	0.48
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	476'686'303.63	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-117'925.62	
Andere Verbindlichkeiten	-564'763.27	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	476'003'614.74	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in %)
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);	420'644'679.36	88.25
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-251'496.07	-0.05
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 **31'385'809.08** **6.59**

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte **2'609'080.27** **0.55**

CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	12'695	CAD	23.92	225'548.99	0.05
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	2'009	EUR	161.38	381'825.11	0.08
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2'845	EUR	188.85	632'752.83	0.13
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	10'554	EUR	42.86	532'726.24	0.11
FR0000125585	CASINO GUICHARD PERRACHON	3'463	EUR	39.81	162'360.17	0.03
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	7'872	GBP	1'661.00	175'644.52	0.04
US30303M1027	FACEBOOK INC-A	152	USD	159.79	23'258.27	0.00
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	4'090	USD	121.27	474'964.14	0.10

Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte **28'776'728.81** **6.04**

AU3CB0216141	5.2500 % BNG 5 1/4 05/20/24 MTN	500	AUD	112.63%	413'637.91	0.09
AU3CB0244960	3.5000 % LHN VX 3 1/2 06/16/22 MTN	440	AUD	101.29%	327'348.16	0.07
CH0008680370	4.0000 % SWISS 4 04/08/28	3'180	CHF	139.95%	4'450'410.00	0.93
CH0180513183	1.6250 % ROSW 1 5/8 09/23/22	1'400	CHF	107.55%	1'505'700.00	0.32
CH0194695083	2.0000 % BALHOL 2 10/12/22	100	CHF	108.05%	108'050.00	0.02
CH0200252788	3.4500 % TELEFO 3.45 12/14/22 EMTN	150	CHF	114.70%	172'050.00	0.04
CH0229751927	2.5000 % BANBRA 2 1/2 06/20/19 EMTN	300	CHF	102.08%	306'240.00	0.06
CH0241528741	1.2500 % BNG 1 1/4 04/30/24 EMTN	1'500	CHF	108.25%	1'623'750.00	0.34
CH0242596143	1.1250 % PFZENT 1 1/8 04/28/23 449	500	CHF	106.36%	531'800.00	0.11
CH0270382093	0.5000 % CAF 0 1/2 02/26/26 EMTN	1'000	CHF	100.65%	1'006'500.00	0.21
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	1'200	CHF	101.16%	1'213'920.00	0.26
CH0272024669	0.5000 % JPM 0 1/2 12/04/23 EMTN	700	CHF	101.75%	712'250.00	0.15
CH0306626224	2.0000 % NANTDR 2 02/02/26	1'000	CHF	102.65%	1'026'500.00	0.22
CH0310451841	0.7500 % UBS 0 3/4 02/22/22	800	CHF	102.20%	817'600.00	0.17
CH0347556919	0.3750 % PSHYPO 0 3/8 03/21/28 644	1'000	CHF	100.05%	1'000'500.00	0.21
CH0352595927	0.5500 % SGSNVX 0.55 03/03/26	200	CHF	100.05%	200'100.00	0.04
CH0357520433	0.2500 % ANZNZ 0 1/4 09/22/25 EMTN	1'000	CHF	99.10%	991'000.00	0.21
FR0000486763	5.5000 % CFF 5 1/2 01/26/27 EMTN	321	GBP	129.56%	558'683.60	0.12
US172967JJ16	2.4000 % C 2.4 02/18/20	1'000	USD	98.84%	946'530.14	0.20
US172967KK69	2.7000 % C 2.7 03/30/21	200	USD	98.55%	188'741.04	0.04
US21688AAE29	3.3750 % RABOBK 3 3/8 05/21/25 MTN	250	USD	98.62%	236'103.46	0.05
US219868BS46	4.3750 % CAF 4 3/8 06/15/22	1'150	USD	104.88%	1'154'936.46	0.24
US404280AN99	4.0000 % HSBC 4 03/30/22	200	USD	102.41%	196'133.72	0.04
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	500	USD	111.27%	532'775.12	0.11
USP7088CTF33	5.3750 % NATURA 5 3/8 02/01/23 REGS	1'000	USD	99.99%	957'494.66	0.20
XS0070553820	0.0000 % EIB 0 11/06/26	200	USD	77.05%	147'558.50	0.03
XS0208653773	4.8750 % LLOYDS 4 7/8 12/20/24 EMTN	500	GBP	119.69%	803'910.62	0.17
XS0578264870	3.8750 % TOTAL 3 7/8 12/14/18 EMTN	1'200	GBP	102.06%	1'645'160.20	0.35
XS0616897616	5.1250 % SANUK 5 1/8 04/14/21 EMTN	1'100	GBP	111.15%	1'642'411.76	0.35
XS0938722666	4.1250 % GLENLN 4 1/8 05/30/23 REGS	1'000	USD	100.78%	965'059.70	0.20
XS1075371986	2.1250 % KOREA 2 1/8 06/10/24	1'000	EUR	107.82%	1'269'808.38	0.27
XS1227684062	2.2500 % NRW 2 1/4 04/16/25 EMTN	200	USD	95.05%	182'047.42	0.04
XS1231116481	2.0000 % SWEDA 2 05/12/20	1'000	USD	98.37%	942'017.96	0.20

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Umrechnungskurse	AUD	1 = CHF	0.73452708
	CAD	1 = CHF	0.74275742
	CNY	1 = CHF	0.15220052
	DKK	100 = CHF	15.79963400
	EUR	1 = CHF	1.17770043
	GBP	1 = CHF	1.34332128
	HKD	100 = CHF	12.20136800
	JPY	100 = CHF	0.90042300
	NOK	100 = CHF	12.19725000
	SEK	100 = CHF	11.43430300
	SGD	1 = CHF	0.73026767
	USD	1 = CHF	0.95760000

Collateral ausgeliehene Effekten

Collateral in Fondswährung	Aktien	Obligationen
35'315'705.69	24.16 %	75.84 %

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	94'927'853.75	19.94
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	37'230'428.69	7.82
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	31'385'809.08	6.59

* 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 31.03.2018

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:	31'385'809.08
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, die Entschädigung der Depotbank (PAF) für die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch für das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Fondsvermögens.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I - Balance

Klasse	Periode	PVK	PAF	PMF	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 – 31.03.2018	1.35 %	0.25 %	1.10 %	2.00 %	4.00 %
CT CHF	16.11.2017 – 31.03.2018	0.73 %	0.25 %	0.48 %	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.

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.

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