

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I - Ambition

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

Jahresbericht per 30. September 2018

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	2
Abschlusszahlen	3
Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment II.....	29
Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	29
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	29
Pauschale Verwaltungskommission	30
Benchmark.....	30
TER.....	30
Ausschüttung des Nettoertrags 2017 / 2018	30
Thesaurierung des Nettoertrags 2017 / 2018.....	31
Erklärung der Fussnoten	31
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	32
Bericht der Prüfgesellschaft.....	33

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 18.01.2019

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

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

Verwaltungsrat

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

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

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

Geschäftsführung

Hans Frey
 Geschäftsführer

Andreas Hogg
 stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services

Silvia Karrer
 Leiterin Administration & Operations

Delegation der Anlageentscheide

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Fondsadministration

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND I - AMBITION

Übersicht	Rechnungsperiode bis	01.10.2017 30.09.2018	01.10.2016 30.09.2017	01.10.2015 30.09.2016	01.10.2014 30.09.2015
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		117'193'264.09	112'430'014.89	109'115'780.81	113'795'950.10
Klasse AA CHF 14)	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		113'897'760.95	112'430'014.89	109'115'780.81	113'795'950.10
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		115'296.587	113'813.373	120'923.000	129'417.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		987.87	987.85	902.36	879.30
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP 21)		987.87	-	-	-
Ausschüttung je Anteil		6.80	7.60	7.00	9.00
Ausserordentliche Ausschüttung je Anteil		-	-	2.20	-
Total Expense Ratio (synthetische TER)		1.50 %	1.59 %	1.59 %	1.59 %
Klasse CT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'295'503.14			
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		33'360.001			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		98.79			
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		98.79			
Thesaurierung je Anteil		1.25			
Total Expense Ratio (synthetische TER)		0.86 %			

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

Performance	YTD / 30.09.2018	2017	2016	2015
Klasse AA CHF	-3.05 %	12.46 %	2.26 %	-2.88 %
Klasse CT CHF (Lancierung 16.11.2017)	-2.57 %	1.45 %	-	-

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2018	30.09.2017
Bankguthaben auf Sicht	8'887'362.60	5'436'370.73
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	67'188'866.65	58'659'335.08
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	13'858'877.10	16'864'432.75
Strukturierte Produkte	5'946'161.78	3'367'247.95
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	14'070'763.85	25'262'503.66
Andere Anlagen - Metallkonten	6'983'748.33	2'352'694.73
Derivative Finanzinstrumente	-36'416.97	118'394.99
Sonstige Vermögenswerte	480'554.91	508'115.62
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	117'379'918.25	112'569'095.51
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-40'761.80	-6'465.74
Andere Verbindlichkeiten	-145'892.36	-132'614.88
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	117'193'264.09	112'430'014.89

Entwicklung der Anzahl Anteile	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
Klasse AA CHF	bis	30.09.2018	30.09.2017
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		113'813.373	120'923.000
Ausgegebene Anteile		31'166.620	6'934.261
Zurückgenommene Anteile		-29'683.406	-14'043.888
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		115'296.587	113'813.373

Entwicklung der Anzahl Anteile	Rechnungsperiode	Lancierung 16.11.2017
Klasse CT CHF	bis	30.09.2018
Ausgegebene Anteile		39'707.601
Zurückgenommene Anteile		-6'347.600
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		33'360.001

Veränderung des Nettofondsvermögens (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
	bis	30.09.2018	30.09.2017
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		112'430'014.89	109'115'780.81
Ausbezahlte Ausschüttung		-842'770.21	-1'105'149.40
Saldo aus dem Anteilverkehr		4'721'750.31	-6'748'713.52
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		884'269.10	11'168'097.00
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		117'193'264.09	112'430'014.89

Erfolgsrechnung (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.10.2017	01.10.2016
	bis	30.09.2018	30.09.2017
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		52.39	5.91
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-33'044.17	-4'152.51
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		1'558'128.25	1'404'661.75
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		504'914.78	583'214.62
Erträge der Gratisaktien		44'561.96	86'101.44
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		282'580.02	284'593.73
Erträge aus Wertpapierleihe		8'196.15	12'306.35
Erträge aus Rückvergütung		764.95	3.14
Sonstige Erträge		0.00	200.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		119'354.22	26'674.22
Total Ertrag		2'485'508.55	2'393'608.65
Aufwand			
Passivzinsen		-456.96	-405.68
Prüfaufwand		-487.02	-4'147.91
Reglementarische Vergütungen		-1'602'714.70	-1'458'542.81
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)		39'947.27	0.00
Sonstige Aufwendungen		-7'820.76	-10'346.76
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-80'317.09	-50'452.25
Total Aufwand		-1'651'849.26	-1'523'895.41
Nettoertrag / Verlust		833'659.29	869'713.24
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		5'206'159.63	2'099'472.53
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		144'773.55	164'713.94
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP) 21)		16'293.32	0.00
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste 4)		-39'947.27	0.00
Realisierter Erfolg		6'160'938.52	3'133'899.71
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-5'276'669.42	8'034'197.29
Gesamterfolg		884'269.10	11'168'097.00

Verwendung des Erfolges	Klasse AA CHF	30.09.2018	30.09.2017
Nettoertrag		791'878.27	869'713.24
Vortrag des Vorjahres		11'899.75	7'168.15
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		803'778.02	876'881.39
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg		784'016.79	864'981.64
Vortrag auf neue Rechnung		19'761.23	11'899.75
Total		803'778.02	876'881.39

Verwendung des Erfolges	Klasse CT CHF	30.09.2018
Nettoertrag		41'781.02
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg		41'781.02
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		14'623.36
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		27'157.66
Total		41'781.02

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

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind								83'326'029.85	70.98	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								67'188'866.65	57.23	
AEA000201011	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	12'802	10'670	415	23'057	AED	8.01	49'115.00	0.04	a)
AED001301012	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	23'384	0	23'384	0	AED	0.00	0.00	0.00	
AEDFXA0M6V00	DP WORLD LTD	0	224	224	0	USD	0.00	0.00	0.00	
AEE000401019	EMIRATES TELECOM GROUP CO	0	610	0	610	AED	16.56	2'686.39	0.00	a)
AE								51'801.39	0.04	
AT0000743059	OMV AG	1'121	0	178	943	EUR	48.39	51'771.41	0.04	a)
AT								51'771.41	0.04	
GB0000566504	BHP BILLITON PLC	3'207	4'790	0	7'997	GBP	1'671.20	170'237.57	0.15	a)
AU								170'237.57	0.15	
BE0003470755	SOLVAY SA	897	0	897	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003739530	UCB SA	473	2'408	538	2'343	EUR	77.40	205'748.14	0.18	a)
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	0	328	328	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003810273	PROXIMUS	2'734	0	2'734	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0003826436	TELENET GROUP HOLDING NV	169	1'071	1'240	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974256852	COLRUYT SA	313	0	313	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE0974264930	AGEAS	0	265	265	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
BE								205'748.14	0.18	
BMG0692U1099	AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	0	2'742	0	2'742	USD	57.71	154'569.63	0.13	a)
BMG3223R1088	EVEREST RE GROUP LTD	633	767	633	767	USD	228.47	171'171.00	0.15	a)
BMG5876H1051	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	9'629	0	9'629	0	USD	0.00	0.00	0.00	
BM								325'740.63	0.28	
BRBBDCACNPR8	BANCO BRADESCO SA-PREF	5'074	2'507	6'332	1'249	BRL	28.67	8'758.64	0.01	a)
BRBRKMACNPA4	BRASKEM SA-PREF A	600	0	600	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRCPLEACNPB9	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	3'951	0	3'951	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRELETACNOR6	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4'633	2'000	6'633	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRELETACNPB7	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	30	2'400	0	2'430	BRL	18.62	11'067.07	0.01	a)
BREMBRACNOR4	EMBRAER SA	33	1'900	1'000	933	BRL	19.83	4'525.34	0.00	a)
BRENBRACNOR2	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	8'501	3'100	11'601	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRGGBRACNPR8	GERDAU SA-PREF	3'100	23'675	0	26'775	BRL	17.19	112'577.57	0.10	a)
BRITUBACNPR1	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2'644	1'000	1'067	2'577	BRL	44.13	27'816.01	0.02	a)
BRJBSSACNOR8	JBS SA	6	39'523	0	39'529	BRL	9.38	90'691.21	0.08	a)
BRMULTACNOR5	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	0	1'400	1'400	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRPCARACNPR0	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	1'644	1'900	1'644	1'900	BRL	87.51	40'668.47	0.03	a)
BRPETRACNPR6	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	7'000	5'938	0	12'938	BRL	21.09	66'740.62	0.06	a)
BRQUALACNOR6	QUALICORP CONS E CORR SEG SA	4'136	1'800	5'900	36	BRL	16.48	145.11	0.00	a)
BRSANBCDAM13	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1'500	0	0	1'500	BRL	35.71	13'101.70	0.01	a)
BRSBSPACNOR5	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	0	900	900	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRTIMPACNOR1	TIM PARTICIPACOES SA	16'724	6'100	22'824	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BRVALEACNOR0	VALE SA	0	9'215	2'915	6'300	BRL	59.82	92'179.32	0.08	a)
BRVALEACNPA3	VALE SA-PREF	3'121	0	3'121	0	BRL	0.00	0.00	0.00	
BR								468'271.06	0.40	
CA01626P4033	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	0	2'154	0	2'154	CAD	64.61	105'168.80	0.09	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	0	7'934	0	7'934	CAD	20.55	123'209.88	0.10	a)
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	0	1'257	314	943	CAD	106.54	75'921.69	0.06	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	0	5'715	5'715	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0679011084	BARRICK GOLD CORP	0	3'607	3'607	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA0977512007	BOMBARDIER INC-B	0	80'744	25'826	54'918	CAD	4.60	190'903.57	0.16	a)
CA1254911003	CI FINANCIAL CORP	0	10'482	10'482	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	0	547	547	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	0	364	364	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA15135U1093	CENOVUS ENERGY INC	0	4'524	0	4'524	CAD	12.97	44'340.86	0.04	a)
CA22576C1014	CRESCENT POINT ENERGY CORP	0	15'936	15'936	0	CAD	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
CA2918434077	EMPIRE CO LTD 'A'	0	10'377	845	9'532	CAD	23.54	169'563.35	0.14	a)
CA2925051047	ENCANA CORP	0	1'860	1'860	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	0	4'109	4'109	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3039011026	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0	148	148	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA3180714048	FINNING INTERNATIONAL INC	0	8'112	549	7'563	CAD	31.55	180'316.29	0.15	a)
CA3809564097	GOLDCORP INC	0	857	857	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA39138C1068	GREAT-WEST LIFECO INC	0	8'058	0	8'058	CAD	31.34	190'839.27	0.16	a)
CA4480551031	HUSKY ENERGY INC	0	13'929	2'475	11'454	CAD	22.68	196'309.68	0.17	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	0	4'703	4'703	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4558711038	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	0	5'033	0	5'033	CAD	51.65	196'443.99	0.17	a)
CA47215Q1046	JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	0	9'400	9'400	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	0	40'342	40'342	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA53278L1076	LINAMAR CORP	0	1'838	0	1'838	CAD	59.51	82'656.49	0.07	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	0	678	0	678	CAD	66.36	33'999.89	0.03	a)
CA5592224011	MAGNA INTERNATIONAL INC	0	3'677	0	3'677	CAD	67.85	188'531.96	0.16	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	0	14'854	0	14'854	CAD	23.09	259'184.39	0.22	a)
CA59151K1084	METHANEX CORP	0	1'242	0	1'242	CAD	101.96	95'695.81	0.08	a)
CA68272K1030	ONEX CORPORATION	0	1'451	1'451	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	0	5'040	0	5'040	CAD	49.15	187'195.57	0.16	a)
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	0	2'776	2'776	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	0	8'862	0	8'862	CAD	28.06	187'914.77	0.16	a)
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	0	3'936	3'936	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	0	1'567	0	1'567	CAD	103.54	122'607.96	0.10	a)
CA78460T1057	SNC-LAVALIN GROUP INC	0	3'959	3'959	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA82028K2002	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	0	1'634	0	1'634	CAD	25.17	31'079.70	0.03	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	0	6'183	0	6'183	CAD	51.35	239'928.14	0.20	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	0	1'229	0	1'229	CAD	49.98	46'418.34	0.04	a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	0	1'034	1'034	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	0	6'072	2'558	3'514	CAD	78.49	208'428.73	0.18	a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	0	2'063	0	2'063	CAD	73.51	114'600.67	0.10	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	0	2'296	0	2'296	CAD	97.77	169'636.38	0.14	a)
CA									3'440'896.18	2.91
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	1'360	233	105	1'488	CHF	445.40	662'755.20	0.56	a)
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	249	38	47	240	CHF	2'413.00	579'120.00	0.49	a)
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	3'510	910	0	4'420	CHF	310.20	1'371'084.00	1.17	a)
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	49'470	9'182	74	58'578	CHF	84.40	4'943'983.20	4.22	a)
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	15'645	2'661	1'331	16'975	CHF	237.75	4'035'806.25	3.45	a)
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	54'596	14'340	0	68'936	CHF	14.75	1'016'806.00	0.87	a)
CH0012138605	ADECCO GROUP AG-REG	5'652	2'242	0	7'894	CHF	51.54	406'856.76	0.35	a)
CH0012214059	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	13'920	2'829	0	16'749	CHF	48.45	811'489.05	0.69	a)
CH0012221716	ABB LTD-REG	27'740	10'118	0	37'858	CHF	23.19	877'927.02	0.75	a)
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	782	763	0	1'545	CHF	390.30	603'013.50	0.51	a)
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1'393	255	21	1'627	CHF	372.00	605'244.00	0.52	a)
CH0038863350	NESTLE SA-REG	47'807	8'961	0	56'768	CHF	81.82	4'644'757.76	3.97	a)
CH0126881561	SWISS RE AG	11'783	3'376	0	15'159	CHF	90.60	1'373'405.40	1.17	a)
CH0198251305	COCA-COLA HBC AG-DI	5'271	682	405	5'548	GBP	2'613.00	184'661.24	0.16	a)
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	10'216	1'887	66	12'037	CHF	80.00	962'960.00	0.82	a)
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	71'045	16'833	0	87'878	CHF	15.50	1'362'109.00	1.16	a)
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	10'641	3'401	11'756	2'286	EUR	15.67	40'641.33	0.03	a)
CH									24'482'619.71	20.86
US05965X1090	BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	2'627	300	1'800	1'127	USD	31.98	35'205.30	0.03	a)
US29274F1049	ENEL AMERICAS SA-ADR	0	4'516	0	4'516	USD	7.73	34'098.80	0.03	a)
US29278D1054	ENEL CHILE SA-ADR	4'487	1'624	3'303	2'808	USD	5.01	13'741.70	0.01	a)
CL									83'045.80	0.07

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017				30.09.2018				
BMG8162K1137	SIHUA PHARMACEUTICAL HLDGS	8'000	15'000	0	23'000	HKD	1.60	4'593.83	0.00	a)
CNE000000073	JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	0	3'600	0	3'600	CNY	5.16	2'637.13	0.00	a)
CNE0000019V8	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	0	2'400	0	2'400	CNY	36.79	12'534.89	0.01	a)
CNE000001FB1	AISINO CORP-A	0	15'500	0	15'500	CNY	27.83	61'238.46	0.05	a)
CNE1000001Q4	CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	0	44'000	0	44'000	HKD	5.01	27'518.03	0.02	a)
CNE1000001W2	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1'500	3'500	1'500	3'500	HKD	47.25	20'644.14	0.02	a)
CNE1000001Z5	BANK OF CHINA LTD-H	263'547	95'000	13'000	345'547	HKD	3.48	150'111.25	0.13	a)
CNE100000205	BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	0	57'000	0	57'000	HKD	5.87	41'767.63	0.04	a)
CNE1000002G3	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	121'146	44'000	42'352	122'794	HKD	7.21	110'519.59	0.09	a)
CNE1000002H1	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	81'243	36'000	0	117'243	HKD	6.84	100'108.26	0.09	a)
CNE1000002N9	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	0	8'000	0	8'000	HKD	6.95	6'940.67	0.01	a)
CNE1000002Q2	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	133'566	48'000	32'354	149'212	HKD	7.84	146'031.55	0.12	a)
CNE1000002V2	CHINA TELECOM CORP LTD-H	30'000	0	0	30'000	HKD	3.89	14'567.93	0.01	a)
CNE100000338	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	0	17'000	17'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
CNE1000003G1	IND & COMM BK OF CHINA-H	0	152'000	0	152'000	HKD	5.72	108'534.17	0.09	a)
CNE1000003J5	JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	2'000	0	2'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
CNE1000003W8	PETROCHINA CO LTD-H	0	22'000	0	22'000	HKD	6.34	17'411.61	0.01	a)
CNE100000437	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	0	14'000	0	14'000	HKD	2.79	4'875.95	0.00	a)
CNE1000004C8	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	29'599	82'000	29'599	82'000	HKD	4.78	48'929.26	0.04	a)
CNE1000004L9	WEICHAI POWER CO LTD-H	63'704	24'000	3'000	84'704	HKD	9.70	102'565.79	0.09	a)
CNE1000004S4	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	40'000	0	36'000	4'000	HKD	6.51	3'250.63	0.00	a)
CNE100000502	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	0	30'000	0	30'000	HKD	3.01	11'272.35	0.01	a)
CNE100000593	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	0	9'000	0	9'000	HKD	9.24	10'381.05	0.01	a)
CNE1000006Z4	HUANENG POWER INTL INC-H	0	28'000	0	28'000	HKD	5.15	18'000.81	0.02	a)
CNE1000009Q7	CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	800	6'600	0	7'400	HKD	30.20	27'897.52	0.02	a)
CNE100000BG0	CRRC CORP LTD - H	0	15'000	0	15'000	HKD	7.15	13'388.26	0.01	a)
CNE100000HF9	CHINA MINSHENG BANKING COR-H	0	15'000	0	15'000	HKD	5.81	10'879.13	0.01	a)
CNE100000Q35	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	16'053	0	16'053	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
CNE100000Q43	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	211'000	72'000	12'000	271'000	HKD	3.84	129'905.45	0.11	a)
CNE100000WS1	HUANENG RENEWABLES CORP-H	0	20'000	0	20'000	HKD	2.33	5'817.18	0.00	a)
CNE100001922	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	0	4'100	0	4'100	HKD	37.55	19'218.55	0.02	a)
CNE100001NV2	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	60'000	0	60'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
CNE100001QW3	CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	0	87'000	0	87'000	HKD	3.47	37'685.61	0.03	a)
CNE100001SR9	CHINA VANKE CO LTD-H	0	5'800	0	5'800	HKD	25.90	18'752.30	0.02	a)
CNE100002342	CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	0	173'808	0	173'808	HKD	1.55	33'630.11	0.03	a)
CNE1000029W3	POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	0	18'394	0	18'394	HKD	4.93	11'320.09	0.01	a)
HK0000083920	SUN ART RETAIL GROUP LTD	101'177	32'000	50'500	82'677	HKD	10.18	105'065.31	0.09	a)
HK0285041858	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	0	40'000	40'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0308001558	CHINA TRAVEL INTL INV HK	0	54'000	0	54'000	HKD	2.52	16'987.18	0.01	a)
HK0883013259	CNOOC LTD	7'000	19'000	0	26'000	HKD	15.50	50'307.40	0.04	a)
HK0992009065	LENOVO GROUP LTD	0	144'000	0	144'000	HKD	5.72	102'821.84	0.09	a)
HK1093012172	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	385	0	0	385	HKD	16.62	798.76	0.00	a)
HK3377040226	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	5'500	1'500	0	7'000	HKD	3.45	3'014.70	0.00	a)
KYG011981035	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	0	6'000	0	6'000	HKD	11.06	8'283.87	0.01	a)
KYG210961051	CHINA MENGNIU DAIRY CO	2'000	0	0	2'000	HKD	26.05	6'503.76	0.01	a)
KYG2140A1076	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	0	12'903	0	12'903	HKD	3.60	5'798.56	0.00	a)
KYG245241032	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	64'184	19'000	14'000	69'184	HKD	9.87	85'241.23	0.07	a)
KYG2453A1085	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	0	8'297	8'297	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG2953R1149	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	0	1'500	1'500	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG3701A1067	FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	0	2'780	0	2'780	HKD	5.07	1'759.46	0.00	a)
KYG3777B1032	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	37'559	12'000	18'000	31'559	HKD	15.60	61'457.47	0.05	a)
KYG5264Y1089	KINGSOFT CORP LTD	0	15'000	15'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG5635P1090	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	0	500	0	500	HKD	20.20	1'260.81	0.00	a)
KYG811511131	SHUI ON LAND LTD	0	82'500	82'500	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG875721634	TENCENT HOLDINGS LTD	4'614	2'100	1'200	5'514	HKD	323.20	222'466.68	0.19	a)
KYG8878S1030	TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	19'414	2'000	19'414	2'000	HKD	14.38	3'590.18	0.00	a)
KYG9884T1013	YUZHOU PROPERTIES CO	0	18'022	0	18'022	HKD	3.18	7'154.13	0.01	a)
US01609W1027	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	825	300	148	977	USD	164.76	157'236.00	0.13	a)
US05278C1071	AUTOHOME INC-ADR	0	1'100	1'100	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US64110W1027	NETEASE INC-ADR	0	100	100	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US92763W1036	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	1'200	200	1'400	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US98426T1060	YY INC-ADR	1'216	300	1'516	0	USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
CN								2'172'676.52	1.82	
US40053W1018	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE	0	468	0	468	USD	7.76	3'547.43	0.00	a)
CO								3'547.43	0.00	
CZ0005112300	CEZ AS	0	682	0	682	CZK	567.50	17'032.03	0.01	a)
CZ0008040318	MONETA MONEY BANK AS	0	15'319	15'319	0	CZK	0.00	0.00	0.00	
CZ								17'032.03	0.01	
DE0005089031	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	0	1'558	1'558	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005552004	DEUTSCHE POST AG-REG	3'863	861	4'724	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	4'339	10'991	0	15'330	EUR	13.89	241'496.43	0.21	a)
DE0005773303	FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	228	0	228	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005785604	FRESENIUS SE & CO KGAA	2'666	0	2'666	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0005937007	MAN SE	193	1'325	1'518	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006047004	HEIDELBERGCEMENT AG	426	215	641	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0006062144	COVESTRO AG	2'200	344	424	2'120	EUR	69.86	168'030.11	0.14	a)
DE0006070006	HOCHTIEF AG	0	1'447	321	1'126	EUR	142.80	182'427.07	0.16	a)
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2'970	0	2'970	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007037129	RWE AG	0	711	0	711	EUR	21.25	17'141.59	0.01	a)
DE0007100000	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	0	163	163	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007164600	SAP SE	140	466	606	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	115	310	425	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE0007664005	VOLKSWAGEN AG	1'051	182	622	611	EUR	150.10	104'050.60	0.09	a)
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	1'339	54	634	759	EUR	151.60	130'546.03	0.11	a)
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	6'463	515	1'034	5'944	EUR	21.16	142'697.75	0.12	a)
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	268	1'555	268	1'555	EUR	192.00	338'730.50	0.29	a)
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	0	1'076	0	1'076	EUR	190.75	232'862.47	0.20	a)
DE000A1J5RX9	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	7'884	30'232	7'884	30'232	EUR	3.64	124'884.98	0.11	a)
DE000A1PHFF7	HUGO BOSS AG -ORD	0	1'367	0	1'367	EUR	66.32	102'857.44	0.09	a)
DE000BASF111	BASF SE	220	210	430	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000BAY0017	BAYER AG-REG	2'679	1'627	2'971	1'335	EUR	76.51	115'883.64	0.10	a)
DE000BFB0019	METRO AG	2'868	1'802	4'670	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000CBK1001	COMMERZBANK AG	0	1'362	1'362	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000ENAG999	E.ON SE	16'922	1'901	18'823	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000EVNK013	EVONIK INDUSTRIES AG	0	2'487	2'487	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
DE000SHA0159	SCHAEFFLER AG	9'484	4'725	1'119	13'090	EUR	11.01	163'512.00	0.14	a)
DE000TUAG000	TUI AG-DI	0	8'840	8'840	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
DE								2'065'120.61	1.77	
ES0111845014	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	5'017	682	5'699	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0113900J37	BANCO SANTANDER SA	8'196	24'897	0	33'093	EUR	4.34	162'778.86	0.14	a)
ES0113902318	BANCO SANTANDER SA-INTERIM	0	57	57	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0124244E34	MAPFRE SA	32'159	0	32'159	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0140609019	CAIXABANK S.A	14'138	3'759	0	17'897	EUR	3.94	79'961.08	0.07	a)
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	30'185	1'020	10'673	20'532	EUR	6.34	147'640.73	0.13	a)
ES0144583178	IBERDROLA SA-INTERIM	0	450	450	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0144583186	IBERDROLA SA-INTERIM	0	570	570	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173516115	REPSOL SA	11'076	1'826	1'528	11'374	EUR	17.17	221'503.05	0.19	a)
ES0173516131	REPSOL SA-INTERIM	0	284	284	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0173516149	REPSOL SA-INTERIM	0	353	353	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES0178430E18	TELEFONICA SA	3'266	0	3'266	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
ES								611'883.72	0.53	
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R SHS	6'320	3'213	2'278	7'255	EUR	16.48	135'608.07	0.12	a)
FI0009005987	UPM-KYMMENE OYJ	5'752	0	3'192	2'560	EUR	33.80	98'170.12	0.08	a)
FI								233'778.19	0.20	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
FR0000039299	BOLLORE	0	16'056	16'056	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE SA	4'501	1'991	0	6'492	EUR	12.39	91'228.86	0.08	a)
FR0000120222	CNP ASSURANCES	7'131	1'492	947	7'676	EUR	20.76	180'794.41	0.15	a)
FR0000120271	TOTAL SA	3'184	1'740	589	4'335	EUR	55.84	274'635.82	0.23	a)
FR0000120503	BOUYGUES SA	4'080	241	349	3'972	EUR	37.23	167'774.11	0.14	a)
FR0000120578	SANOFI	1'458	308	1'458	308	EUR	76.56	26'753.17	0.02	a)
FR0000120685	NATIXIS	21'705	3'550	25'255	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	0	46	46	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000121261	MICHELIN (CGDE)	0	844	0	844	EUR	102.95	98'580.60	0.08	a)
FR0000121501	PEUGEOT SA	7'953	8'346	8'835	7'464	EUR	23.23	196'717.74	0.17	a)
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	7'880	0	819	7'061	EUR	17.19	137'709.77	0.12	a)
FR0000125007	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	3'684	197	3'881	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000125486	VINCI SA	0	1'858	0	1'858	EUR	82.02	172'897.28	0.15	a)
FR0000125585	CASINO GUICHARD PERRACHON	425	805	430	800	EUR	36.22	32'874.65	0.03	a)
FR0000130213	LAGARDERE SCA	5'310	385	5'695	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000130452	EIFFAGE	0	2'208	499	1'709	EUR	96.16	186'448.63	0.16	a)
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	283	0	283	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000131104	BNP PARIBAS	4'059	437	4'496	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0000133308	ORANGE	12'383	3'006	1'580	13'809	EUR	13.74	215'185.79	0.18	a)
FR0010040865	GECINA SA	0	425	425	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010208488	ENGIE	5'627	4'991	0	10'618	EUR	12.67	152'570.51	0.13	a)
FR0010221234	EUTELSAT COMMUNICATIONS	6'108	3'295	6'108	3'295	EUR	20.36	76'112.48	0.06	a)
FR0010259150	IPSEN	0	1'102	1'102	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0010411983	SCOR SE	4'184	2'696	3'097	3'783	EUR	40.00	171'679.72	0.15	a)
NL0000235190	AIRBUS SE	0	346	0	346	EUR	108.18	42'466.43	0.04	a)
FR								2'224'429.97	1.89	
ES0177542018	INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	4'496	0	0	4'496	EUR	7.40	37'757.05	0.03	a)
GB0000536739	ASHTREAD GROUP PLC	0	6'505	0	6'505	GBP	2'437.00	201'930.87	0.17	a)
GB0000811801	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	6'112	0	0	6'112	GBP	567.00	44'143.45	0.04	a)
GB0002162385	AVIVA PLC	0	34'208	1'253	32'955	GBP	489.50	205'482.06	0.18	a)
GB0002374006	DIAGEO PLC	640	407	1'047	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0002875804	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2'470	0	2'470	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0004082847	STANDARD CHARTERED PLC	0	5'320	0	5'320	GBP	636.40	43'126.25	0.04	a)
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	60'303	0	51'674	8'629	GBP	669.80	73'621.64	0.06	a)
GB0005603997	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	55'029	3'019	25'292	32'756	GBP	262.20	109'401.54	0.09	a)
GB0005758098	MEGGITT PLC	7'742	0	7'742	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0006043169	WM MORRISON SUPERMARKETS	55'879	0	24'812	31'067	GBP	259.40	102'652.42	0.09	a)
GB0006825383	PERSIMMON PLC	3'317	0	1'384	1'933	GBP	2'365.00	58'232.16	0.05	a)
GB0007188757	RIO TINTO PLC	5'882	0	5'882	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0007980591	BP PLC	62'027	1'637	11'771	51'893	GBP	589.30	389'533.77	0.33	a)
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	66'634	19'888	86'522	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0008782301	TAYLOR WIMPEY PLC	9'667	4'134	0	13'801	GBP	171.80	30'201.86	0.03	a)
GB0008847096	TESCO PLC	72'497	12'926	33'636	51'787	GBP	239.80	158'186.65	0.13	a)
GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	2'650	4'528	2'650	4'528	GBP	1'536.80	88'638.75	0.08	a)
GB0009697037	BABCOCK INTL GROUP PLC	0	12'369	6'585	5'784	GBP	723.00	53'268.01	0.05	a)
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	246	0	246	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0030646508	GKN PLC	36'980	0	36'980	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB0030913577	BT GROUP PLC	37'910	88'755	88'129	38'536	GBP	225.30	110'593.02	0.09	a)
GB0031274896	MARKS & SPENCER GROUP PLC	12'690	3'722	0	16'412	GBP	288.80	60'375.21	0.05	a)
GB0031348658	BARCLAYS PLC	0	34'522	0	34'522	GBP	171.78	75'538.51	0.06	a)
GB0033195214	KINGFISHER PLC	35'882	7'732	2'384	41'230	GBP	258.00	135'498.02	0.12	a)
GB00B019KW72	SAINSBURY (J) PLC	43'362	2'560	37'223	8'699	GBP	321.80	35'657.86	0.03	a)
GB00B01FLG62	G4S PLC	0	32'184	32'184	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	5'677	207	5'884	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	5'120	1'427	0	6'547	GBP	1'723.00	143'690.32	0.12	a)
GB00B5ZN1N88	SEGRO PLC	0	9'052	9'052	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B77J0862	OLD MUTUAL PLC	65'399	0	65'399	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00B7KR2P84	EASYJET PLC	0	3'694	0	3'694	GBP	1'314.00	61'828.99	0.05	a)
GB00BD3VFW73	CONVATEC GROUP PLC	9'957	0	9'957	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BDCPN049	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	4'183	2'052	4'424	1'811	EUR	39.15	80'435.74	0.07	a)
GB00BDVZY277	ROYAL MAIL PLC	30'846	3'082	23'528	10'400	GBP	477.10	63'203.72	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			30.09.2018					
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	113'660	12'935	126'595	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BKMKR23	RSA INSURANCE GROUP PLC	0	11'269	11'269	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BVFD7Q58	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2'597	0	2'597	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BY9D0Y18	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	36'200	11'174	47'374	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
GB00BZ1G4322	MELROSE INDUSTRIES PLC	0	43'341	0	43'341	GBP	199.90	110'359.98	0.09	a)
JE00B4T3BW64	GLENCORE PLC	54'102	2'085	12'491	43'696	GBP	331.70	184'623.53	0.16	a)
NL0006144495	RELX NV	6'171	795	6'966	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0010545661	CNH INDUSTRIAL NV	0	6'683	0	6'683	EUR	10.35	78'475.57	0.07	a)
VGG607541015	MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	0	296	0	296	USD	68.56	19'822.94	0.02	a)
GB									2'756'279.89	2.35
GRS003003027	NATIONAL BANK OF GREECE	0	16'389	16'389	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
GRS282183003	JUMBO SA	321	0	321	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
GRS419003009	OPAP SA	2'510	1'261	1'412	2'359	EUR	9.04	24'194.63	0.02	a)
GR									24'194.63	0.02
HK0000049939	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	6'000	14'000	0	20'000	HKD	9.22	23'019.07	0.02	a)
HK0000055878	CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	0	5'200	0	5'200	HKD	27.45	17'818.56	0.02	a)
HK0165000859	CHINA EVERBRIGHT LTD	0	6'000	6'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
HK0836012952	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	0	18'000	0	18'000	HKD	13.84	31'098.22	0.03	a)
HK0941009539	CHINA MOBILE LTD	181	0	0	181	HKD	77.15	17'743.18	0.00	a)
KYG2113L1068	CHINA RESOURCES CEMENT	0	10'000	0	10'000	HKD	9.11	11'372.22	0.01	a)
KYG525621408	KINGBOARD HOLDINGS LTD	0	13'000	13'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG5257K1076	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	0	25'000	25'000	0	HKD	0.00	0.00	0.00	
KYG8167W1380	SINO BIOPHARMACEUTICAL	0	2'000	0	2'000	HKD	7.30	1'822.55	0.00	a)
HK									86'873.80	0.08
HU0000123096	RICHTER GEDEON NYRT	0	1'023	0	1'023	HUF	5'210.00	18'695.55	0.02	a)
HU									18'695.55	0.02
ID1000057003	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	129'500	46'900	176'400	0	IDR	0.00	0.00	0.00	
ID1000094204	BANK DANAMON INDONESIA TBK	73'900	0	73'900	0	IDR	0.00	0.00	0.00	
ID1000096605	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	29	0	0	29	IDR	7'400.00	14.07	0.00	a)
ID1000111305	ADARO ENERGY TBK PT	397'672	143'900	196'000	345'572	IDR	1'835.00	41'566.87	0.04	a)
ID1000111602	PERUSAHAAN GAS NEGARA PERSER	0	323'900	12'581	311'319	IDR	2'250.00	45'915.66	0.04	a)
ID1000117708	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	0	159'400	0	159'400	IDR	5'075.00	53'027.00	0.05	a)
ID1000118201	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	0	46'800	0	46'800	IDR	3'150.00	9'663.38	0.01	a)
ID									150'186.98	0.14
IE00BD1RP616	BANK OF IRELAND GROUP PLC	13'344	8'330	6'957	14'717	EUR	6.60	110'117.61	0.09	a)
IE00BGH1M568	PERRIGO CO PLC	0	1'387	1'387	0	USD	0.00	0.00	0.00	
IE									110'117.61	0.09
IM00B5VQMV65	GVC HOLDINGS PLC	0	8'763	0	8'763	GBP	918.50	102'525.50	0.09	a)
IM									102'525.50	0.09
US2561352038	DR. REDDY'S LABORATORIES-ADR	598	1'000	400	1'198	USD	34.60	40'489.14	0.03	a)
US45104G1040	ICICI BANK LTD-SPON ADR	11'871	4'000	6'500	9'371	USD	8.49	77'714.00	0.07	a)
US4567881085	INFOSYS LTD-SP ADR	3'077	10'010	3'077	10'010	USD	10.17	99'439.90	0.08	a)
US8565522039	STATE BANK OF INDI-GDR REG S	2'142	700	100	2'742	USD	36.35	97'359.32	0.08	a)
US8765685024	TATA MOTORS LTD-SPON ADR	800	1'700	69	2'431	USD	15.36	36'473.87	0.03	a)
US92242Y1001	VEDANTA LTD-ADR	5'213	9'100	11'311	3'002	USD	12.80	37'534.13	0.03	a)
US97651M1099	WIPRO LTD-ADR	14'200	18'200	10'460	21'940	USD	5.21	111'655.47	0.10	a)
USY5217N1183	LARSEN & TOUBRO-GDR REG S	0	5'500	5'500	0	USD	0.00	0.00	0.00	
USY541641194	MAHINDRA & MAHINDRA-SPON GDR	1'083	6'783	0	7'866	USD	14.00	107'569.12	0.09	a)
IN									608'234.95	0.51
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	13'072	47'446	60'518	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0000072626	INTESA SANPAOLO-RSP	39'935	3'511	43'446	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003128367	ENEL SPA	19'148	6'123	0	25'271	EUR	4.41	126'497.11	0.11	a)
IT0003132476	ENI SPA	13'631	3'360	5'445	11'546	EUR	16.28	213'285.82	0.18	a)
IT0003497168	TELECOM ITALIA SPA	64'818	15'631	80'449	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0003497176	TELECOM ITALIA-RSP	55'199	0	55'199	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0005239360	UNICREDIT SPA	0	697	697	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
IT0005278236	PIRELLI & C SPA	0	11'440	0	11'440	EUR	7.23	93'813.83	0.08	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
IT								433'596.76	0.37	
JP3040890000	JAPAN PRIME REALTY INVESTMEN	0	22	22	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3102000001	AISIN SEIKI CO LTD	2'300	600	2'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3111200006	ASAHI KASEI CORP	3'000	10'400	800	12'600	JPY	1'723.00	186'698.42	0.16	a)
JP3112000009	AGC INC	3'400	400	0	3'800	JPY	4'715.00	154'081.36	0.13	a)
JP3116000005	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	0	1'900	1'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3122800000	AMADA HOLDINGS CO LTD	2'400	2'500	4'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3126340003	ALFRESA HOLDINGS CORP	1'700	500	0	2'200	JPY	3'040.00	57'514.99	0.05	a)
JP3131090007	IIDA GROUP HOLDINGS CO LTD	0	7'000	7'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3134800006	IHI CORP	0	1'100	0	1'100	JPY	4'305.00	40'724.02	0.03	a)
JP3143600009	ITOCHU CORP	4'100	9'700	13'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3164800009	NOK CORP	800	1'100	1'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3165000005	SOMPO HOLDINGS INC	2'200	1'700	2'200	1'700	JPY	4'839.00	70'743.96	0.06	a)
JP3165700000	NTT DATA CORP	0	17'100	1'400	15'700	JPY	1'573.00	212'379.79	0.18	a)
JP3174410005	OJI HOLDINGS CORP	0	31'000	2'000	29'000	JPY	825.00	205'748.54	0.18	a)
JP3190000004	OBAYASHI CORP	8'100	7'000	0	15'100	JPY	1'076.00	139'724.97	0.12	a)
JP3197600004	ONO PHARMACEUTICAL CO LTD	0	3'900	3'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3197800000	OMRON CORP	0	600	600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3200450009	ORIX CORP	0	25'700	12'300	13'400	JPY	1'842.00	212'265.42	0.18	a)
JP3210200006	KAJIMA CORP	9'000	2'000	11'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3242800005	CANON INC	1'900	8'300	10'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3249600002	KYOCERA CORP	0	700	0	700	JPY	6'820.00	41'055.11	0.03	a)
JP3256000005	KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD	0	5'600	5'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3268950007	MEDIPAL HOLDINGS CORP	2'100	1'600	0	3'700	JPY	2'371.00	75'442.85	0.06	a)
JP3269600007	KURARAY CO LTD	8'800	800	9'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3270000007	KURITA WATER INDUSTRIES LTD	0	800	800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3284600008	KOITO MANUFACTURING CO LTD	0	900	900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3292200007	JTEKT CORP	900	2'500	3'400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3293200006	COCA-COLA BOTTLERS JAPAN HOL	0	2'500	2'500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3300600008	KONICA MINOLTA INC	0	7'100	0	7'100	JPY	1'208.00	73'758.16	0.06	a)
JP3336560002	SUNTORY BEVERAGE & FOOD LTD	0	700	700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3351200005	SHIZUOKA BANK LTD/THE	0	18'000	18'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3358800005	SHIMIZU CORP	14'100	9'000	16'100	7'000	JPY	1'037.00	62'425.44	0.05	a)
JP3366800005	SHOWA SHELL SEKIYU KK	15'000	0	5'300	9'700	JPY	2'407.00	200'785.64	0.17	a)
JP3386030005	JFE HOLDINGS INC	0	7'800	0	7'800	JPY	2'607.00	174'872.07	0.15	a)
JP3386380004	J FRONT RETAILING CO LTD	0	1'800	1'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3386450005	JXTG HOLDINGS INC	27'500	5'900	3'800	29'600	JPY	858.30	218'481.99	0.19	a)
JP3388200002	AEON CO LTD	4'300	7'000	1'900	9'400	JPY	2'737.50	221'292.55	0.19	a)
JP3397200001	SUZUKI MOTOR CORP	3'600	200	3'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3398000004	SUZUKEN CO LTD	0	2'400	0	2'400	JPY	5'390.00	111'246.11	0.09	a)
JP3399400005	STANLEY ELECTRIC CO LTD	500	1'000	0	1'500	JPY	3'885.00	50'114.93	0.04	a)
JP3401400001	SUMITOMO CHEMICAL CO LTD	0	4'000	0	4'000	JPY	665.00	22'875.28	0.02	a)
JP3404200002	SUMITOMO RUBBER INDUSTRIES	4'200	5'500	9'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3404600003	SUMITOMO CORP	7'200	6'600	700	13'100	JPY	1'894.50	213'427.67	0.18	a)
JP3407400005	SUMITOMO ELECTRIC INDUSTRIES	0	3'400	0	3'400	JPY	1'782.00	52'104.04	0.04	a)
JP3419050004	SEGA SAMMY HOLDINGS INC	0	1'500	1'500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3419400001	SEKISUI CHEMICAL CO LTD	5'300	800	6'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3422950000	SEVEN & I HOLDINGS CO LTD	0	5'400	0	5'400	JPY	5'060.00	234'979.02	0.20	a)
JP3429800000	ANA HOLDINGS INC	4'800	0	4'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3435000009	SONY CORP	0	3'000	200	2'800	JPY	6'966.00	167'736.01	0.14	a)
JP3435350008	SONY FINANCIAL HOLDINGS INC	0	4'400	0	4'400	JPY	2'504.00	94'748.39	0.08	a)
JP3436100006	SOFTBANK GROUP CORP	0	1'400	300	1'100	JPY	11'470.00	108'502.79	0.09	a)
JP3443600006	TAISEI CORP	3'200	4'300	3'200	4'300	JPY	5'180.00	191'550.39	0.16	a)
JP3456000003	TAKASHIMAYA CO LTD	12'000	2'000	14'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3476480003	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	0	2'900	0	2'900	JPY	2'365.50	58'993.72	0.05	a)
JP3493800001	DAI NIPPON PRINTING CO LTD	7'000	1'900	0	8'900	JPY	2'642.00	202'212.33	0.17	a)
JP3526600006	CHUBU ELECTRIC POWER CO INC	0	2'500	0	2'500	JPY	1'718.50	36'946.59	0.03	a)
JP3538800008	TDK CORP	0	600	0	600	JPY	12'390.00	63'930.39	0.05	a)
JP3539220008	T&D HOLDINGS INC	2'600	900	0	3'500	JPY	1'875.00	56'435.73	0.05	a)
JP3546800008	TERUMO CORP	0	500	500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3551500006	DENSO CORP	3'200	1'000	4'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
01.10.2017					30.09.2018					
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	0	300	300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3573000001	TOKYO GAS CO LTD	4'800	0	4'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3592200004	TOSHIBA CORP	0	13'000	13'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	1'616	5'200	0	6'816	JPY	7'095.00	415'878.81	0.35	a)
JP3634200004	TOYODA GOSEI CO LTD	0	2'300	0	2'300	JPY	2'805.00	55'481.16	0.05	a)
JP3657400002	NIKON CORP	5'100	1'200	6'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3672400003	NISSAN MOTOR CO LTD	1'900	0	1'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3678800008	HITACHI HIGH-TECHNOLOGIES CO	0	500	500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3705200008	JAPAN AIRLINES CO LTD	0	4'800	0	4'800	JPY	4'084.00	168'582.23	0.14	a)
JP3729400006	NIPPON EXPRESS CO LTD	2'500	0	2'500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3733000008	NEC CORP	0	4'600	0	4'600	JPY	3'140.00	124'214.50	0.11	a)
JP3733400000	NIPPON ELECTRIC GLASS CO LTD	4'500	300	4'800	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3735400008	NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE	0	5'400	1'500	3'900	JPY	5'132.00	172'121.88	0.15	a)
JP3738600000	NGK SPARK PLUG CO LTD	0	600	0	600	JPY	3'310.00	17'079.06	0.01	a)
JP3752900005	JAPAN POST HOLDINGS CO LTD	0	3'700	3'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3753000003	NIPPON YUSEN KK	4'200	0	4'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3756600007	NINTENDO CO LTD	0	100	100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3758190007	NEXON CO LTD	0	15'500	15'500	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762600009	NOMURA HOLDINGS INC	0	3'600	3'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3762900003	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS	0	7'700	7'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3778630008	BANDAI NAMCO HOLDINGS INC	0	5'100	0	5'100	JPY	4'415.00	193'635.82	0.16	a)
JP3788600009	HITACHI LTD	0	25'200	21'000	4'200	JPY	3'860.00	139'418.82	0.12	a)
JP3802600001	FAMILYMART UNY HOLDINGS CO L	0	300	300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3805010000	FUKUOKA FINANCIAL GROUP INC	22'000	13'000	35'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3814000000	FUJIFILM HOLDINGS CORP	0	5'300	400	4'900	JPY	5'115.00	215'539.33	0.18	a)
JP3814800003	SUBARU CORP	0	3'300	3'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3818000006	FUJITSU LTD	13'000	2'400	14'000	1'400	JPY	8'096.00	97'472.78	0.08	a)
JP3820000002	FUJI ELECTRIC CO LTD	7'000	23'000	25'000	5'000	JPY	4'550.00	195'643.86	0.17	a)
JP3830000000	BROTHER INDUSTRIES LTD	2'200	800	3'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3830800003	BRIDGESTONE CORP	4'700	0	4'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	0	400	400	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3866800000	PANASONIC CORP	7'300	9'000	0	16'300	JPY	1'323.50	185'522.41	0.16	a)
JP3877600001	MARUBENI CORP	12'500	2'400	0	14'900	JPY	1'040.00	133'261.42	0.11	a)
JP3890310000	MS&AD INSURANCE GROUP HOLDIN	5'300	600	5'300	600	JPY	3'794.00	19'576.43	0.02	a)
JP3893600001	mitsui & co ltd	13'000	0	13'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3894900004	isetan mitsukoshi holdings l	0	15'400	0	15'400	JPY	1'395.00	184'748.00	0.16	a)
JP3896800004	mitsubishi gas chemical co	0	1'900	0	1'900	JPY	2'419.00	39'525.22	0.03	a)
JP3897700005	mitsubishi chemical holdings	20'600	1'300	21'900	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3899800001	mitsubishi motors corp	2'400	8'800	0	11'200	JPY	802.00	77'246.21	0.07	a)
JP3902400005	mitsubishi electric corp	6'300	800	7'100	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3902900004	mitsubishi ufj financial gro	43'800	14'900	58'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	0	4'100	0	4'100	JPY	5'637.00	198'754.38	0.17	a)
JP3935600001	YAMAZAKI BAKING CO LTD	9'200	9'300	9'200	9'300	JPY	2'274.00	181'868.81	0.15	a)
JP3939000000	YAMADA DENKI CO LTD	0	12'600	12'600	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	0	2'300	0	2'300	JPY	1'982.00	39'202.73	0.03	a)
JP3951600000	UNICHARM CORP	0	5'100	500	4'600	JPY	3'758.00	148'661.81	0.13	a)
JP3973400009	RICOH CO LTD	0	14'400	0	14'400	JPY	1'220.00	151'080.06	0.13	a)
JP3982800009	ROHM CO LTD	1'000	200	1'200	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
JP								7'168'314.40	6.06	
KR7000030007	WOORI BANK	1'050	1'361	1'050	1'361	KRW	16'900.00	20'254.36	0.02	a)
KR7000270009	KIA MOTORS CORP	0	1'615	0	1'615	KRW	35'100.00	49'917.57	0.04	a)
KR7000660001	SK HYNIX INC	673	454	0	1'127	KRW	73'100.00	72'546.26	0.06	a)
KR7000810002	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	0	172	0	172	KRW	284'000.00	43'015.06	0.04	a)
KR7001040005	CJ CORP	0	30	19	11	KRW	135'000.00	1'307.68	0.00	a)
KR7001450006	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	1'644	595	0	2'239	KRW	41'950.00	82'710.34	0.07	a)
KR7005490008	POSCO	227	82	0	309	KRW	294'500.00	80'134.13	0.07	a)
KR7005930003	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	143	9'951	715	9'379	KRW	46'450.00	383'633.04	0.33	a)
KR7005930003	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	0	0	0	0	USD	0.00	0.00	0.00	
KR7005931001	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	22	1'498	22	1'498	KRW	37'850.00	49'928.84	0.04	a)
KR7005940002	NH INVESTMENT & SECURITIES C	0	1'470	1'470	0	KRW	0.00	0.00	0.00	
KR7006360002	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	0	490	0	490	KRW	52'300.00	22'566.88	0.02	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
KR7009150004	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	0	54	0	54 KRW	139'000.00		6'609.71	0.01	a)
KR7010140002	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	0	553	553	0 KRW	0.00		0.00	0.00	
KR7023530009	LOTTE SHOPPING CO	0	129	0	129 KRW	209'500.00		23'798.39	0.02	a)
KR7024110009	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	0	2'398	0	2'398 KRW	15'250.00		32'202.74	0.03	a)
KR7030000004	CHEIL WORLDWIDE INC	4'632	1'676	5'067	1'241 KRW	21'650.00		23'659.38	0.02	a)
KR7030200000	KT CORP	300	0	113	187 KRW	30'150.00		4'964.81	0.00	a)
KR7032640005	LG UPLUS CORP	0	170	0	170 KRW	18'300.00		2'739.52	0.00	a)
KR7033780008	KT&G CORP	0	210	0	210 KRW	104'000.00		19'232.09	0.02	a)
KR7047040001	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	2'293	0	0	2'293 KRW	5'920.00		11'953.62	0.01	a)
KR7047050000	POSCO DAEWOO CORP	0	805	0	805 KRW	20'950.00		14'850.93	0.01	a)
KR7051910008	LG CHEM LTD	0	140	140	0 KRW	0.00		0.00	0.00	
KR7066570003	LG ELECTRONICS INC	460	166	0	626 KRW	71'000.00		39'138.70	0.03	a)
KR7086790003	HANA FINANCIAL GROUP	1'049	0	1'049	0 KRW	0.00		0.00	0.00	
KR7088350004	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	15'055	4'511	14'805	4'761 KRW	5'290.00		22'178.27	0.02	a)
KR7105560007	KB FINANCIAL GROUP INC	242	0	242	0 KRW	0.00		0.00	0.00	
KR7241560002	DOOSAN BOBCAT INC	0	3'880	1'174	2'706 KRW	40'400.00		96'268.21	0.08	a)
KR								1'103'610.53	0.94	
US8740801043	TAL EDUCATION GROUP- ADR	1'758	768	2'526	0 USD	0.00		0.00	0.00	
KY								0.00	0.00	
LU0061462528	RTL GROUP	1'533	216	1'749	0 EUR	0.00		0.00	0.00	
LU0088087324	SES	0	5'204	0	5'204 EUR	18.90		111'589.10	0.10	a)
LU1598757687	ARCELORMITTAL	0	2'405	0	2'405 EUR	26.80		73'126.12	0.06	a)
LU								184'715.22	0.16	
MX01AC100006	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	3'200	0	3'200	0 MXN	0.00		0.00	0.00	
MX01WA000038	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	40	0	0	40 MXN	57.03		119.16	0.00	a)
MX41BS060005	BANCO SANTANDER MEXICO-B	0	27'400	27'400	0 MXN	0.00		0.00	0.00	
MXP000511016	ALFA S.A.B.-A	37	0	0	37 MXN	24.13		46.64	0.00	a)
MXP001691213	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	57'641	80'000	0	137'641 MXN	15.04		108'137.70	0.09	a)
MXP225611567	CEMEX SAB-CPO	34'158	0	34'158	0 MXN	0.00		0.00	0.00	
MXP2861W1067	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	6'900	14'300	2'293	18'907 MXN	114.26		112'849.16	0.10	a)
MXP370711014	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	0	1'519	0	1'519 MXN	135.30		10'735.86	0.01	a)
MXP370841019	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	0	6'200	6'200	0 MXN	0.00		0.00	0.00	
MXP554091415	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	930	0	930	0 MXN	0.00		0.00	0.00	
MXP690491412	GRUPO FIN SANTANDER-B	27'400	0	27'400	0 MXN	0.00		0.00	0.00	
MX								231'888.52	0.20	
MYL10230O0000	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	7'300	0	7'300	0 MYR	0.00		0.00	0.00	
MYL10820O0006	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	0	7'800	0	7'800 MYR	19.30		35'531.59	0.03	a)
MYL11550O0000	MALAYAN BANKING BHD	13'600	22'300	21'549	14'351 MYR	9.79		33'161.00	0.03	a)
MYL15620O0007	BERJAYA SPORTS TOTO BHD	29	0	0	29 MYR	2.37		16.22	0.00	a)
MYL45880O0009	UMW HOLDINGS BHD	0	4'500	0	4'500 MYR	5.02		5'331.86	0.00	a)
MYL47150O0008	GENTING MALAYSIA BHD	27	0	0	27 MYR	4.99		31.80	0.00	a)
MYL50140O0005	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	29'900	5'600	14'300	21'200 MYR	8.90		44'533.68	0.04	a)
MYL52220O0004	FGV HOLDINGS BHD	86'500	31'300	0	117'800 MYR	1.55		43'096.27	0.04	a)
MYL63990O0009	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	41'500	0	0	41'500 MYR	1.47		14'398.86	0.01	a)
MY								176'101.28	0.15	
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	5'605	899	0	6'504 EUR	2'960.09		218'427.95	0.19	a)
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	17'903	619	10'343	8'179 GBP	2'636.50		274'680.54	0.23	a)
GB00B03MM408	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	0	460	0	460 GBP	2'689.00		15'756.09	0.01	a)
NL00000008977	HEINEKEN HOLDING NV	0	3'606	1'608	1'998 EUR	78.00		176'812.42	0.15	a)
NL00000009082	KONINKLIJKE KPN NV	3'818	0	3'818	0 EUR	0.00		0.00	0.00	
NL00000009355	UNILEVER NV-CVA	5'759	1'083	4'863	1'979 EUR	47.97		107'694.36	0.09	a)
NL0000379121	RANDSTAD NV	0	3'048	0	3'048 EUR	45.98		159'003.47	0.14	a)
NL0009538784	NXP SEMICONDUCTORS NV	521	0	521	0 USD	0.00		0.00	0.00	
NL0010773842	NN GROUP NV	0	3'497	3'497	0 EUR	0.00		0.00	0.00	
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	11'263	0	2'182	9'081 EUR	19.75		203'480.81	0.17	a)
NL								1'155'855.64	0.98	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
PHY2088F1004	DMCI HOLDINGS INC	145'500	169'400	0	314'900	PHP	11.38	64'786.50	0.06	a)
PHY272571498	GLOBE TELECOM INC	0	425	305	120	PHP	2'200.00	4'772.80	0.00	a)
PHY603051020	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	146'755	0	146'755	0	PHP	0.00	0.00	0.00	
PH								69'559.30	0.06	
PLALIOR00045	ALIOR BANK SA	0	939	939	0	PLN	0.00	0.00	0.00	
PLCFRPT00013	CYFROWY POLSAT SA	0	12'978	0	12'978	PLN	22.24	76'485.85	0.07	a)
PLPGNIG00014	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	29'639	7'492	28'525	8'606	PLN	6.47	14'755.17	0.01	a)
PLTAURN00011	TAURON POLSKA ENERGIA SA	3'179	13'802	16'981	0	PLN	0.00	0.00	0.00	
PL								91'241.02	0.08	
PTEDP0AM0009	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	3'002	5'274	0	8'276	EUR	3.18	29'839.88	0.03	a)
PTJMT0AE0001	JERONIMO MARTINS	1'441	0	1'441	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
PT								29'839.88	0.03	
QA0006929770	DOHA BANK QPSC	0	4'380	4'380	0	QAR	0.00	0.00	0.00	
QA0006929838	QATAR INSURANCE CO	0	607	607	0	QAR	0.00	0.00	0.00	
QA0007227737	OOREDOO QPSC	155	0	0	155	QAR	68.98	2'868.01	0.00	a)
QA0007227737	OOREDOO QPSC	310	0	0	310	USD	18.95	5'736.84	0.00	a)
QA000A0KD6J5	BARWA REAL ESTATE CO	0	6'967	718	6'249	QAR	35.00	58'668.35	0.05	a)
QA								67'273.20	0.05	
RU0009029524	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	0	4'527	0	4'527	RUB	38.07	2'570.34	0.00	a)
RU000A0J2Q06	ROSNEFT OIL CO PJSC	0	3'643	0	3'643	RUB	493.00	26'785.71	0.02	a)
RU000A0JPNM1	INTER RAO UES PJSC	0	142'407	0	142'407	RUB	4.11	8'721.63	0.01	a)
US3682872078	GAZPROM PAO -SPON ADR	0	4'021	0	4'021	USD	5.00	19'638.56	0.02	a)
US46630Q2021	VTB BANK JSC -GDR-REG S	0	72'147	0	72'147	USD	1.34	94'363.60	0.08	a)
US48122U2042	SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	3'723	0	3'723	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5591892048	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	0	15'979	15'979	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US55953Q2021	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	0	3'631	3'631	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6074091090	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	6'151	4'200	6'151	4'200	USD	8.53	34'994.84	0.03	a)
US67812M2070	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	0	3'200	0	3'200	USD	7.51	23'468.21	0.02	a)
US69343P1057	LUKOIL PJSC-SPON ADR	553	268	22	799	USD	76.44	59'658.61	0.05	a)
US71922G2093	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	0	4'938	4'938	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US80585Y3080	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	8'592	0	8'592	0	USD	0.00	0.00	0.00	
RU								270'201.50	0.23	
TH0101010R14	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	45	0	0	45	THB	25.25	34.32	0.00	a)
TH0150010R11	KRUNG THAI BANK - NVDR	39'507	0	39'500	7	THB	20.20	4.27	0.00	a)
TH0279010R18	ROBINSON PCL-NVDR	0	1'899	1'899	0	THB	0.00	0.00	0.00	
TH0355010R16	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	26'500	9'600	17'084	19'016	THB	155.00	89'025.92	0.08	a)
TH1074010R12	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	28'500	10'100	600	38'000	THB	81.25	93'255.10	0.08	a)
TH								182'319.61	0.16	
TRAAEFES91A9	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1'452	0	1'452	0	TRY	0.00	0.00	0.00	
TRAEREG191G3	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16'229	5'874	7'468	14'635	TRY	11.03	26'247.90	0.02	a)
TRAOTOSN91H6	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1'586	0	1'586	0	TRY	0.00	0.00	0.00	
TRAPETKM91E0	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	0	1'146	1'146	0	TRY	0.00	0.00	0.00	
TRATHYAO91M5	TURK HAVA YOLLARI AO	0	6'457	0	6'457	TRY	19.09	20'043.02	0.02	a)
TREEGYO00017	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	8'862	1'783	10'645	0	TRY	0.00	0.00	0.00	
TRETAVH00018	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	3'196	0	3'196	0	TRY	0.00	0.00	0.00	
TR								46'290.92	0.04	
KYG3808R1011	GENERAL INTERFACE SOLUTION	9'000	0	9'000	0	TWD	0.00	0.00	0.00	
TW0001216000	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	6'980	3'000	0	9'980	TWD	79.70	25'446.33	0.02	a)
TW0002301009	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	29'592	11'000	0	40'592	TWD	38.40	49'866.39	0.04	a)
TW0002303005	UNITED MICROELECTRONICS CORP	0	45'000	0	45'000	TWD	16.15	23'249.91	0.02	a)
TW0002317005	HON HAI PRECISION INDUSTRY	22'275	8'000	30'275	0	TWD	0.00	0.00	0.00	
TW0002324001	COMPAL ELECTRONICS	0	20'000	0	20'000	TWD	18.95	12'124.82	0.01	a)
TW0002327004	YAGEO CORPORATION	0	1'198	0	1'198	TWD	459.00	17'591.62	0.01	a)
TW0002330008	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	17'625	6'000	0	23'625	TWD	262.50	198'398.05	0.17	a)
TW0002347002	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	0	12'000	0	12'000	TWD	38.95	14'952.88	0.01	a)
TW0002353000	ACER INC	58'000	21'000	0	79'000	TWD	25.25	63'815.28	0.05	a)
TW0002356003	INVENTEC CORP	50'745	12'000	50'745	12'000	TWD	27.40	10'518.84	0.01	a)
TW0002357001	ASUSTEK COMPUTER INC	0	5'000	0	5'000	TWD	264.00	42'228.94	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			30.09.2018					
TW0002474004	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	0	1'000	0	1'000	TWD	336.00	10'749.18	0.01	a)
TW0002823002	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	38'699	17'161	0	55'860	TWD	30.70	54'862.49	0.05	a)
TW0002882008	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	0	5'000	0	5'000	TWD	52.50	8'397.80	0.01	a)
TW0002886009	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	0	30'000	0	30'000	TWD	27.50	26'393.09	0.02	a)
TW0002890001	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	0	80'580	0	80'580	TWD	11.15	28'743.41	0.02	a)
TW0002891009	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	18'000	0	0	18'000	TWD	23.00	13'244.53	0.01	a)
TW0003231007	WISTRON CORP	77'340	31'093	0	108'433	TWD	19.90	69'032.06	0.06	a)
TW0003481008	INNOLUX CORP	78'000	28'000	71'458	34'542	TWD	10.60	11'713.57	0.01	a)
TW0003702007	WPG HOLDINGS LTD	0	26'880	14'000	12'880	TWD	37.90	15'616.77	0.01	a)
TW0006239007	POWERTECH TECHNOLOGY INC	26'941	10'000	0	36'941	TWD	83.30	98'444.13	0.08	a)
TW0006488000	GLOBALWAFERS CO LTD	2'023	1'000	9	3'014	TWD	336.50	32'446.25	0.03	a)
TW0009904003	POU CHEN	39'846	14'000	0	53'846	TWD	32.25	55'554.54	0.05	a)
TW								883'390.88	0.74	
BMG169621056	BUNGE LTD	557	0	557	0	USD	0.00	0.00	0.00	
CA0717341071	BAUSCH HEALTH COS INC	0	4'148	0	4'148	CAD	33.17	103'974.23	0.09	a)
CA91911K1021	BAUSCH HEALTH COS INC	0	4'148	4'148	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
IE00B58JVZ52	SEAGATE TECHNOLOGY	0	1'868	0	1'868	USD	47.35	86'397.76	0.07	a)
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	2'284	2'571	2'510	2'345	USD	86.73	198'663.39	0.17	a)
NL0000687663	AERCAP HOLDINGS NV	466	0	466	0	USD	0.00	0.00	0.00	
NL0011031208	MYLAN NV	0	358	358	0	USD	0.00	0.00	0.00	
PA1436583006	CARNIVAL CORP	1'635	1'298	2'933	0	USD	0.00	0.00	0.00	
SG9999000020	FLEX LTD	0	1'197	1'197	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0010551028	AFLAC INC	1'458	5'862	2'916	4'404	USD	47.07	202'487.01	0.17	a)
US00130H1059	AES CORP	14'671	2'597	2'618	14'650	USD	14.00	200'341.68	0.17	a)
US00206R1023	AT&T INC	0	671	671	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0028241000	ABBOTT LABORATORIES	4'262	174	875	3'561	USD	73.36	255'174.31	0.22	a)
US00287Y1091	ABBVIE INC	1'340	552	1'892	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US00817Y1082	AETNA INC	1'219	0	1'219	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US00971T1016	AKAMAI TECHNOLOGIES INC	0	2'543	0	2'543	USD	73.15	181'704.78	0.15	a)
US0200021014	ALLSTATE CORP	1'955	0	1'955	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US02079K1079	ALPHABET INC-CL C	111	155	153	113	USD	1'193.47	131'733.31	0.11	a)
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	98	62	8	152	USD	1'207.08	179'219.51	0.15	a)
US0231351067	AMAZON.COM INC	74	122	9	187	USD	2'003.00	365'871.18	0.31	a)
US0258161092	AMERICAN EXPRESS CO	0	741	0	741	USD	106.49	77'078.40	0.07	a)
US03027X1000	AMERICAN TOWER CORP	1'464	0	1'464	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0326541051	ANALOG DEVICES INC	1'997	159	2'156	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0357104092	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	13'642	0	13'642	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0367521038	ANTHEM INC	967	0	140	827	USD	274.05	221'381.32	0.19	a)
US0378331005	APPLE INC	4'248	0	2'196	2'052	USD	225.74	452'471.81	0.39	a)
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	4'102	0	4'102	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0394831020	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	0	4'359	472	3'887	USD	50.27	190'866.22	0.16	a)
US03965L1008	ARCONIC INC	2'613	758	3'371	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0538071038	AVNET INC	0	1'484	0	1'484	USD	44.77	64'897.30	0.06	a)
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP	11'927	12'102	24'029	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0718131099	BAXTER INTERNATIONAL INC	2'866	160	379	2'647	USD	77.09	199'323.10	0.17	a)
US0758871091	BECTON DICKINSON AND CO	140	919	209	850	USD	261.00	216'703.08	0.18	a)
US0846707026	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0	208	208	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0865161014	BEST BUY CO INC	2'810	370	700	2'480	USD	79.36	192'246.74	0.16	a)
US0936711052	H&R BLOCK INC	3'785	0	3'785	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US0970231058	BOEING CO/THE	1'002	32	182	852	USD	371.90	309'507.68	0.26	a)
US10922N1037	BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	292	0	292	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US11133T1034	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	0	562	0	562	USD	131.95	72'435.48	0.06	a)
US12503M1080	CBOE GLOBAL MARKETS INC	1'616	0	1'616	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US12504L1098	CBRE GROUP INC - A	0	3'914	0	3'914	USD	44.10	168'602.91	0.14	a)
US12514G1085	CDW CORP/DE	0	1'568	0	1'568	USD	88.92	136'191.86	0.12	a)
US1255091092	CIGNA CORP	1'005	0	1'005	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US1266501006	CVS HEALTH CORP	2'689	510	143	3'056	USD	78.72	234'987.13	0.20	a)
US12673P1057	CA INC	0	3'386	0	3'386	USD	44.15	146'023.69	0.12	a)
US1331311027	CAMDEN PROPERTY TRUST	0	462	462	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	0	2'153	0	2'153	USD	94.93	199'642.57	0.17	a)
US15135B1017	CENTENE CORP	967	776	383	1'360	USD	144.78	192'332.70	0.16	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
US1567001060	CENTURYLINK INC	6'978	3'157	6'978	3'157	USD	21.20	65'375.66	0.06	a)
US1667641005	CHEVRON CORP	0	286	130	156	USD	122.28	18'633.12	0.02	a)
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	8'128	246	1'751	6'623	USD	48.65	314'733.70	0.27	a)
US1729674242	CITIGROUP INC	4'124	0	4'124	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	0	2'606	628	1'978	USD	77.15	149'062.32	0.13	a)
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A	7'270	1'275	8'545	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2003401070	COMERICA INC	0	1'139	1'139	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	0	2'595	0	2'595	USD	77.40	196'193.21	0.17	a)
US2193501051	CORNING INC	4'250	2'921	4'250	2'921	USD	35.30	100'719.12	0.09	a)
US23355L1061	DXC TECHNOLOGY CO	2'194	245	2'439	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2371941053	DARDEN RESTAURANTS INC	1'926	926	1'751	1'101	USD	111.19	119'580.04	0.10	a)
US24703L1035	DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	0	1'389	0	1'389	USD	97.12	131'770.01	0.11	a)
US2473617023	DELTA AIR LINES INC	2'414	539	2'953	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US25470F3029	DISCOVERY INC-C	0	8'179	1'611	6'568	USD	29.58	189'774.11	0.16	a)
US2566771059	DOLLAR GENERAL CORP	0	557	0	557	USD	109.30	59'467.68	0.05	a)
US26078J1007	DOWDUPONT INC	801	356	1'157	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2692464017	E*TRADE FINANCIAL CORP	0	1'410	1'410	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US2791581091	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	0	1'444	0	1'444	USD	26.93	37'984.74	0.03	a)
US2910111044	EMERSON ELECTRIC CO	0	2'856	0	2'856	USD	76.58	213'638.35	0.18	a)
US30161N1019	EXELON CORP	804	4'031	2'423	2'412	USD	43.66	102'864.78	0.09	a)
US30219G1085	EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1'892	415	0	2'307	USD	95.01	214'102.91	0.18	a)
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	484	0	302	182	USD	85.02	15'114.65	0.01	a)
US30303M1027	FACEBOOK INC-A	437	265	382	320	USD	164.46	51'406.25	0.04	a)
US3156161024	F5 NETWORKS INC	0	309	0	309	USD	199.42	60'191.18	0.05	a)
US31620R3030	FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	0	4'849	0	4'849	USD	39.35	186'381.40	0.16	a)
US32008D1063	FIRST DATA CORP- CLASS A	0	2'764	0	2'764	USD	24.47	66'065.95	0.06	a)
US3377381088	FISERV INC	0	1'174	1'174	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US3379321074	FIRSTENERGY CORP	0	3'870	3'870	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US35671D8570	FREEMPORT-MCMORAN INC	1'373	0	1'373	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US3647601083	GAP INC/THE	5'820	0	2'965	2'855	USD	28.85	80'455.84	0.07	a)
US37045V1008	GENERAL MOTORS CO	0	1'357	0	1'357	USD	33.67	44'630.18	0.04	a)
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	0	1'183	0	1'183	USD	77.21	89'220.36	0.08	a)
US3802371076	GODADDY INC - CLASS A	0	1'008	0	1'008	USD	83.39	82'106.99	0.07	a)
US40412C1018	HCA HEALTHCARE INC	0	1'418	684	734	USD	139.12	99'745.03	0.08	a)
US40414L1098	HCP INC	609	0	609	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US40434L1052	HP INC	9'488	4'399	7'455	6'432	USD	25.77	161'907.18	0.14	a)
US42824C1099	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	0	2'352	0	2'352	USD	16.31	37'471.14	0.03	a)
US4361061082	HOLLYFRONTIER CORP	342	0	342	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4370761029	HOME DEPOT INC	0	112	112	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US44107P1049	HOST HOTELS & RESORTS INC	8'965	1'643	955	9'653	USD	21.10	198'952.96	0.17	a)
US4448591028	HUMANA INC	0	44	44	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4461501045	HUNTINGTON BANCSHARES INC	6'846	1'669	0	8'515	USD	14.92	124'096.38	0.11	a)
US44919P5089	IAC/INTERACTIVECORP	0	880	880	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US4581401001	INTEL CORP	6'419	467	6'886	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US46266C1053	IQVIA HOLDINGS INC	0	989	989	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US46284V1017	IRON MOUNTAIN INC	3'507	2'407	387	5'527	USD	34.52	186'365.66	0.16	a)
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	354	282	306	330	USD	112.84	36'373.30	0.03	a)
US4698141078	JACOBS ENGINEERING GROUP INC	0	1'994	0	1'994	USD	76.50	149'002.05	0.13	a)
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	2'350	410	2'536	224	USD	138.17	30'232.04	0.03	a)
US48020Q1076	JONES LANG LASALLE INC	0	914	0	914	USD	144.32	128'848.20	0.11	a)
US4932671088	KEYCORP	3'220	0	3'220	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	0	2'830	0	2'830	USD	66.28	183'220.72	0.16	a)
US4990491049	KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	0	4'918	4'918	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5002551043	KOHL'S CORP	1'576	2'500	2'033	2'043	USD	74.55	148'772.16	0.13	a)
US5010441013	KROGER CO	0	470	470	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	0	917	0	917	USD	173.68	155'569.62	0.13	a)
US5128071082	LAM RESEARCH CORP	1'084	142	1'226	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5178341070	LAS VEGAS SANDS CORP	0	2'707	2'707	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5218652049	LEAR CORP	0	1'401	507	894	USD	145.00	126'622.58	0.11	a)
US5253271028	LEIDOS HOLDINGS INC	2'920	0	2'920	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US5272881047	LEUCADIA NATIONAL CORP	6'299	524	6'823	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US58155Q1031	MCKESSON CORP	892	155	705	342	USD	132.65	44'313.80	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			30.09.2018					
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	1'218	1'420	1'218	1'420	USD	70.94	98'397.75	0.08	a)
US59156R1086	METLIFE INC	1'783	1'690	1'783	1'690	USD	46.72	77'125.00	0.07	a)
US5949181045	MICROSOFT CORP	3'810	819	813	3'816	USD	114.37	426'310.61	0.36	a)
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	1'273	1'361	2'634	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US60879B1070	MOMO INC-SPON ADR	1'055	0	1'055	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6153691059	MOODY'S CORP	0	446	446	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US61945C1036	MOSAIC CO/THE	0	3'850	0	3'850	USD	32.48	122'146.89	0.10	a)
US6200763075	MOTOROLA SOLUTIONS INC	0	1'774	250	1'524	USD	130.14	193'732.03	0.17	a)
US64110D1046	NETAPP INC	0	5'546	3'272	2'274	USD	85.89	190'782.58	0.16	a)
US6475811070	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1'256	100	1'356	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US65249B1098	NEWS CORP - CLASS A	12'752	682	13'434	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6558441084	NORFOLK SOUTHERN CORP	0	173	0	173	USD	180.50	30'502.05	0.03	a)
US6703461052	NUCOR CORP	197	0	197	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	0	4'843	0	4'843	USD	18.43	87'185.74	0.07	a)
US68389X1054	ORACLE CORP	5'047	0	5'047	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6936561009	PVH CORP	136	547	683	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US6937181088	PACCAR INC	2'251	540	879	1'912	USD	68.19	127'354.48	0.11	a)
US7043261079	PAYCHEX INC	0	785	785	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC	413	138	551	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7127041058	PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	0	9'943	0	9'943	USD	17.12	166'274.96	0.14	a)
US7134481081	PEPSICO INC	1'111	0	1'111	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7153471005	PERSPECTA INC	0	932	932	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7170811035	PFIZER INC	6'288	2'269	925	7'632	USD	44.07	328'539.10	0.28	a)
US72651A2078	PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	0	2'214	700	1'514	USD	24.53	36'276.81	0.03	a)
US74251V1026	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2'589	195	792	1'992	USD	58.59	114'003.58	0.10	a)
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	0	174	174	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7433151039	PROGRESSIVE CORP	3'843	177	972	3'048	USD	71.04	211'506.43	0.18	a)
US7443201022	PRUDENTIAL FINANCIAL INC	0	2'060	0	2'060	USD	101.32	203'876.91	0.17	a)
US7458671010	PULTEGROUP INC	0	839	839	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US74834L1008	QUEST DIAGNOSTICS INC	1'831	1'905	1'986	1'750	USD	107.91	184'461.35	0.16	a)
US74876Y1010	QUINTILES IMS HOLDINGS INC	759	0	759	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7512121010	RALPH LAUREN CORP	0	468	0	468	USD	137.55	62'879.94	0.05	a)
US7593516047	REINSURANCE GROUP OF AMERICA	0	1'167	551	616	USD	144.56	86'983.02	0.07	a)
US7841171033	SEI INVESTMENTS COMPANY	0	2'038	2'038	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US78467J1007	SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	0	3'044	0	3'044	USD	56.83	168'977.14	0.14	a)
US85207U1051	SPRINT CORP	0	8'231	0	8'231	USD	6.54	52'581.87	0.04	a)
US8718291078	SYSCO CORP	3'490	170	992	2'668	USD	73.25	190'897.00	0.16	a)
US8725901040	T-MOBILE US INC	0	820	820	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8740541094	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	0	354	354	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US87612E1064	TARGET CORP	0	1'144	0	1'144	USD	88.21	98'571.08	0.08	a)
US8793691069	TELEFLEX INC	0	186	186	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US90130A2006	TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	1'030	0	1'030	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9024941034	TYSON FOODS INC-CL A	1'648	678	2'326	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	1'438	49	215	1'272	USD	266.04	330'551.93	0.28	a)
US9139031002	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1'062	172	1'234	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US91529Y1064	UNUM GROUP	0	1'144	1'144	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US91913Y1001	VALERO ENERGY CORP	0	1'129	0	1'129	USD	113.75	125'444.32	0.11	a)
US92276F1003	VENTAS INC	2'583	0	2'583	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US92339V1008	VEREIT INC	19'879	2'399	0	22'278	USD	7.26	157'985.95	0.13	a)
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	0	2'261	2'261	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	0	201	201	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9285634021	VMWARE INC-CLASS A	1'580	0	1'198	382	USD	156.06	58'231.85	0.05	a)
US9290891004	VOYA FINANCIAL INC	0	4'160	420	3'740	USD	49.67	181'456.03	0.15	a)
US9311421039	WALMART INC	3'067	123	3'190	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9314271084	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2'658	457	0	3'115	USD	72.90	221'815.16	0.19	a)
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	2'333	0	2'333	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	0	952	952	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9581021055	WESTERN DIGITAL CORP	1'885	315	2'200	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9598021098	WESTERN UNION CO	0	7'424	0	7'424	USD	19.06	138'218.61	0.12	a)
US96145D1054	WESTROCK CO	2'870	179	0	3'049	USD	53.44	159'158.39	0.14	a)
US9815581098	WORLDPAY INC-CLASS A	0	1'300	0	1'300	USD	101.27	128'596.70	0.11	a)
US9841216081	XEROX CORP	3'478	0	3'478	0	USD	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
US9897011071	ZIONS BANCORP NA	0	1'773	1'773	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US									14'142'049.78	12.03
GB00B17BBQ50	INVESTEC PLC	4'578	6'889	4'578	6'889	GBP	539.60	47'350.87	0.04	a)
ZAE000005443	PICK N PAY STORES LTD	3'233	0	3'233	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000006284	SAPPI LIMITED	0	4'495	0	4'495	ZAR	8'875.00	27'536.51	0.02	a)
ZAE000011953	NETCARE LTD	0	28'291	0	28'291	ZAR	2'421.00	47'277.44	0.04	a)
ZAE000012084	SHOPRITE HOLDINGS LTD	496	0	496	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000013017	PSG GROUP LTD	769	0	769	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000015889	NASPERS LTD-N SHS	109	118	101	126	ZAR	305'164.00	26'540.84	0.02	a)
ZAE000018123	GOLD FIELDS LTD	1'316	0	0	1'316	ZAR	3'403.00	3'091.21	0.00	a)
ZAE000028296	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	2'292	0	0	2'292	ZAR	8'350.00	13'210.28	0.01	a)
ZAE000044897	TELKOM SA SOC LTD	0	5'055	5'055	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000066692	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	0	710	710	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000067211	IMPERIAL HOLDINGS LTD	239	6'704	239	6'704	ZAR	17'500.00	80'980.95	0.07	a)
ZAE000070660	SANLAM LTD	5'028	1'820	6'848	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000081949	INVESTEC LTD	0	3'257	0	3'257	ZAR	9'953.00	22'376.01	0.02	a)
ZAE000084992	EXXARO RESOURCES LTD	4'309	1'422	5'731	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000109815	STANDARD BANK GROUP LTD	7'894	2'499	1'287	9'106	ZAR	17'500.00	109'995.90	0.09	a)
ZAE000117321	BIDVEST GROUP LTD	755	0	755	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000145892	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	51'802	23'124	10'902	64'024	ZAR	2'456.00	108'538.04	0.09	a)
ZAE000192787	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	8'428	0	8'428	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000202149	NOVUS HOLDINGS LTD	38	0	0	38	ZAR	415.00	10.89	0.00	a)
ZAE000216537	BID CORP LTD	261	0	261	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZAE000248498	FORTRESS REIT LTD-A	0	8'428	8'428	0	ZAR	0.00	0.00	0.00	
ZA									486'908.94	0.40
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte									13'858'877.10	11.81
AU0000QBCHF5	6.5000 % Q 6 1/2 07/12/21 MTN	300	0	300	0	AUD	110.20%	0.00	0.00	
AU0000QLQAB5	3.2500 % QTC 3 1/4 07/21/28 28	0	500	500	0	AUD	100.71%	0.00	0.00	
AU3CB0230134	4.5000 % CAF 4 1/2 06/05/25 MTN	0	500	500	0	AUD	103.10%	0.00	0.00	
AU3CB0236263	4.0000 % CS 4 03/09/21 MTN	200	0	200	0	AUD	102.59%	0.00	0.00	
AU3CB0242147	3.5000 % WSTP 3 1/2 02/07/22 MTN	400	0	400	0	AUD	101.78%	0.00	0.00	
AU3CB0249878	3.1000 % ANZ 3.1 01/18/23 MTN	0	500	500	0	AUD	99.98%	0.00	0.00	
AU3CB0251239	4.0000 % LLOYDS 4 03/07/25 MTN	0	410	0	410	AUD	99.57%	288'532.86	0.25	a)
AU3FN0037495	3.1700 % VZ 0 02/17/23 MTN	270	0	0	270	AUD	100.41%	191'612.39	0.16	a)
AU3SG0001522	2.7500 % WATC 2 3/4 10/20/22 22	0	500	500	0	AUD	100.89%	0.00	0.00	
XS1074107910	4.7500 % EIBKOR 4 3/4 06/03/21 EMTN	400	0	0	400	AUD	103.90%	293'742.16	0.25	a)
XS1094768469	4.2500 % CCLAU 4 1/4 08/12/21 EMTN	0	500	500	0	AUD	103.72%	0.00	0.00	
AUD									773'887.41	0.66
CA06367X7W56	2.2700 % BMO 2.27 07/11/22 DPNT	0	500	0	500	CAD	97.48%	368'336.57	0.31	a)
CA13509PDV28	2.3500 % CANHOU 2.35 09/15/23	0	500	0	500	CAD	98.70%	372'942.48	0.32	a)
CA13509PFR97	1.1500 % CANHOU 1.15 12/15/21	0	500	0	500	CAD	95.93%	362'464.89	0.31	a)
CA13509PGS61	2.6500 % CANHOU 2.65 12/15/28	0	500	0	500	CAD	98.47%	372'043.21	0.32	a)
CA136069V324	2.9000 % CM 2.9 09/14/21 DPNT	0	500	0	500	CAD	100.01%	377'892.26	0.32	a)
CA36158ZBV72	4.6000 % GE 4.6 01/26/22 MTN	500	0	0	500	CAD	104.35%	394'275.50	0.34	a)
CA40427HRV73	3.5580 % HSBC 3.558 10/04/17 DPNT	200	0	200	0	CAD	100.00%	0.00	0.00	
CA40427HSW48	1.8160 % HSBC 1.816 07/07/20 DPNT	0	500	0	500	CAD	98.28%	371'355.54	0.32	a)
CA626209JG63	4.8750 % BCMFA 4 7/8 06/03/19	200	0	0	200	CAD	101.89%	153'993.74	0.13	a)
CA669827FV45	4.1500 % NS 4.15 11/25/19	200	0	0	200	CAD	102.21%	154'477.38	0.13	a)
XS1140286490	1.8750 % RENTEN 1 7/8 11/21/19 REGS	500	0	500	0	CAD	99.59%	0.00	0.00	
CAD									2'927'781.57	2.50
CH0188295312	3.5000 % CLNVX 3 1/2 09/26/22	200	0	200	0	CHF	111.61%	0.00	0.00	
CH0200044771	1.5000 % NANTDR 1 1/2 02/15/21	300	0	0	300	CHF	102.60%	307'800.00	0.26	a)
CH0240672227	1.6250 % SYNNVX 1 5/8 11/01/24	200	0	0	200	CHF	99.45%	198'900.00	0.17	a)
CH0255893049	1.2500 % GLENLN 1 1/4 12/01/20 EMTN	0	100	0	100	CHF	101.80%	101'800.00	0.09	a)
CH0271288547	0.5000 % PSHYPO 0 1/2 05/05/28 605	200	0	200	0	CHF	100.19%	0.00	0.00	
CH0274758835	1.1250 % MDLZ 1 1/8 12/30/25	0	300	0	300	CHF	102.00%	306'000.00	0.26	a)
CH0278341224	1.0000 % CS 1 04/14/23 EMTN	200	100	0	300	CHF	102.15%	306'450.00	0.26	a)
CH0278875940	0.6250 % FABUH 0 5/8 05/27/22	200	0	0	200	CHF	101.15%	202'300.00	0.17	a)

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
CH0357676177	0.5000 % PFZENT 0 1/2 10/12/29 493	200	0	200	0	CHF	98.96%	0.00	0.00	
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	100	0	0	100	CHF	100.00%	100'000.00	0.09	a)
CH0373476032	1.1250 % AUTNSW 1 1/8 12/08/25 0	0	200	0	200	CHF	97.45%	194'900.00	0.17	a)
CH0398633377	0.3750 % LIMECO 0 3/8 09/25/26	0	200	0	200	CHF	99.65%	199'300.00	0.17	a)
CH0404311687	0.7000 % SOCGEN 0.7 02/26/25 EMTN	0	200	0	200	CHF	96.95%	193'900.00	0.17	a)
CH0407809794	0.2500 % KIWI 0 1/4 10/18/23	0	500	500	0	CHF	99.50%	0.00	0.00	
CH0409606362	1.0000 % TQLAU 1 12/08/25 EMTN	0	300	0	300	CHF	99.25%	297'750.00	0.25	a)
CHF								2'409'100.00	2.06	
ES00000126A4	1.8000 % SPGBEI 1.8 11/30/24	200	0	200	0	EUR	119.16%	0.00	0.00	
ES0000012932	4.2000 % SPGB 4.2 01/31/37	100	0	0	100	EUR	132.10%	149'868.62	0.13	a)
FR0013200813	0.2500 % FRTR 0 1/4 11/25/26	200	0	200	0	EUR	97.76%	0.00	0.00	
XS1054534422	2.5500 % WMT 2.55 04/08/26	300	0	300	0	EUR	111.14%	0.00	0.00	
XS1315181708	2.7500 % PERU 2 3/4 01/30/26	100	100	0	200	EUR	109.30%	248'003.00	0.21	a)
XS1432493879	2.6250 % INDON 2 5/8 06/14/23 REGS	0	300	0	300	EUR	104.95%	357'212.27	0.30	a)
XS1489184900	1.8750 % GLENLN 1 7/8 09/13/23 EMTN	100	0	0	100	EUR	101.52%	115'175.86	0.10	a)
EUR								870'259.75	0.74	
XS0355738799	7.6250 % C 7 5/8 04/03/18 EMTN	500	0	500	0	GBP	100.00%	0.00	0.00	
XS0371452037	7.1250 % ANVAU 7 1/8 06/26/18 EMTN	300	0	300	0	GBP	100.00%	0.00	0.00	
XS0604380724	4.3250 % BPLN 4.325 12/10/18 EMTN	300	0	300	0	GBP	100.59%	0.00	0.00	
XS0616897616	5.1250 % SANUK 5 1/8 04/14/21 EMTN	800	0	800	0	GBP	109.23%	0.00	0.00	
XS1221677476	2.1250 % WFC 2 1/8 04/22/22 EMTN	0	200	200	0	GBP	100.25%	0.00	0.00	
XS1550975079	3.1250 % BACR 3 1/8 01/17/24 EMTN	0	300	0	300	GBP	99.45%	380'021.76	0.32	a)
XS1730883961	1.0000 % NESNVX 1 06/11/21 EMTN	0	500	500	0	GBP	99.15%	0.00	0.00	
GBP								380'021.76	0.32	
US00037BAB80	2.8750 % ABBNVX 2 7/8 05/08/22	900	0	900	0	USD	98.14%	0.00	0.00	
US01609WAT99	3.4000 % BABA 3.4 12/06/27	0	300	0	300	USD	93.43%	273'796.06	0.23	a)
US03524BAE65	3.7000 % ABIBB 3.7 02/01/24	115	0	0	115	USD	99.73%	112'029.83	0.10	a)
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	500	0	0	500	USD	97.88%	478'031.27	0.41	a)
US06738EAE59	3.6500 % BACR 3.65 03/16/25	0	300	0	300	USD	93.93%	275'249.54	0.23	a)
US105756BZ27	4.6250 % BRAZIL 4 5/8 01/13/28	0	200	0	200	USD	91.71%	179'166.61	0.15	a)
US136069XY29	2.7000 % CM 2.7 02/02/21	0	500	500	0	USD	98.44%	0.00	0.00	
US21685WDD65	3.8750 % RABOBK 3 7/8 02/08/22	500	0	500	0	USD	100.81%	0.00	0.00	
US219868BS46	4.3750 % CAF 4 3/8 06/15/22	383	0	383	0	USD	102.47%	0.00	0.00	
US369604BH58	4.5000 % GE 4 1/2 03/11/44	500	0	0	500	USD	94.31%	460'610.04	0.39	a)
US458182BV36	7.0000 % IADB 7 06/15/25	150	0	150	0	USD	120.77%	0.00	0.00	
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	200	0	0	200	USD	107.33%	209'683.80	0.18	a)
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	500	0	100	400	USD	104.46%	408'161.74	0.35	a)
US50066CAF68	2.8750 % KORGAS 2 7/8 07/29/18 REGS	300	0	300	0	USD	100.00%	0.00	0.00	
US61746BDJ26	3.7500 % MS 3 3/4 02/25/23 GMTN	500	0	500	0	USD	99.79%	0.00	0.00	
US74977SCA87	4.7500 % RABOBK 4 3/4 01/15/20 REGS	500	0	500	0	USD	101.94%	0.00	0.00	
US857524AB80	5.0000 % POLAND 5 03/23/22	250	0	0	250	USD	105.20%	256'903.28	0.22	a)
US88032XAE40	2.9850 % TENCNT 2.985 01/19/23 REGS	0	500	0	500	USD	96.78%	472'668.64	0.40	a)
US91911TAP84	6.2500 % VALEBZ 6 1/4 08/10/26	500	0	0	500	USD	109.35%	534'075.17	0.45	a)
USP1905CAE05	4.7500 % BRFSBZ 4 3/4 05/22/24 REGS	0	300	0	300	USD	91.23%	267'331.60	0.23	a)
USP4949BAJ37	3.8750 % BIMBOA 3 7/8 06/27/24 REGS	500	0	0	500	USD	98.32%	480'209.53	0.41	a)
USP7088CTF33	5.3750 % NATURA 5 3/8 02/01/23 REGS	0	500	0	500	USD	97.03%	473'879.87	0.40	a)
USU75000BD74	3.3500 % ROSW 3.35 09/30/24 REGS	500	500	500	500	USD	98.96%	483'296.22	0.41	a)
USY5749LAA99	3.0430 % MALAYS 3.043 04/22/25 REGS	0	500	0	500	USD	95.41%	465'972.67	0.40	a)
XS0938722666	4.1250 % GLENLN 4 1/8 05/30/23 REGS	300	0	0	300	USD	99.73%	292'257.58	0.25	a)
XS1041751980	2.5000 % ICBCAS 2 1/2 11/21/17 EMTN	400	0	400	0	USD	100.00%	0.00	0.00	
XS1231116481	2.0000 % SWEDA 2 05/12/20	200	0	200	0	USD	98.22%	0.00	0.00	
XS1433450258	2.6641 % KBN 0 06/16/20 REGS	450	0	450	0	USD	100.54%	0.00	0.00	
XS1485745704	2.1250 % QNBK 2 1/8 09/07/21 EMTN	200	0	0	200	USD	95.34%	186'250.36	0.16	a)
XS1622312434	2.7500 % NTBKKK 2 3/4 05/30/22 REGS	200	0	0	200	USD	96.36%	188'252.80	0.16	a)
USD								6'497'826.61	5.53	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
01.10.2017			30.09.2018							
Bezugsrechte									0.00	0.00
CH0382671664	CS REF GREEN PR BEZUGSRECHT 201	0	970	970		0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0385998353	UBS PROPERTY FUND - SWISS RE	0	2'990	2'990		0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0386890344	FONDS IMMOBILIER ROMAND-RTS	0	409	409		0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0395719070	SCHRODER IMMOPLUS-RIGHTS	0	135	135		0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0412174762	IMMO HELVETIC-RTS	0	272	272		0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0423561494	BONHOTE IMMOB BEZUGSRECHT 2018	0	305	305		0 CHF	0.00	0.00	0.00	
DE000A2LQ1S0	DEUTSCHE LUFTHANSA AG	0	5'429	5'429		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06139009Q9	BANCO SANTANDER SA-RTS	0	8'196	8'196		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809F4	IBERDROLA SA-RTS	0	20'741	20'741		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06445809G2	IBERDROLA SA-RTS	0	19'962	19'962		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06735169B1	REPSOL SA-RTS	0	11'076	11'076		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
ES06735169C9	REPSOL SA-RTS	0	12'018	12'018		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013283116	TOTAL SA-SCRIP	3'184	0	3'184		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013301744	TOTAL SA-SCRIP	0	3'218	3'218		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013321452	TOTAL SA-SCRIP	0	4'083	4'083		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013333374	TOTAL SA-SCRIP	0	4'299	4'299		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
FR0013358967	TOTAL SA-SCRIP	0	4'335	0	4'335	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
IT0005333874	RIGHTS INTESA SANPAOLO SPA	0	42'875	42'875		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
KRA010140184	SAMSUNG HVY IND RGHT 2018-13.04.2	0	291	291		0 KRW	0.00	0.00	0.00	
NL0012650592	UNILEVER NV-SCRIP	0	5'759	5'759		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
NL0012661888	ROYAL DUTCH SHELL PLC-SCRIP	0	5'024	5'024		0 EUR	0.00	0.00	0.00	
Diverse									0.00	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen									2'278'286.10	1.94
CH0002769351	CREDIT SUISSE REALESTATE FUND INT	250	0	0	250	CHF	189.80	47'450.00	0.04	a)
CH0002770102	IMMO HELVETIC	272	0	0	272	CHF	206.50	56'168.00	0.05	a)
CH0002782263	LA FONCIERE	71	710	71	710	CHF	106.40	75'544.00	0.06	a)
CH0002785456	SOLVALOR 61	370	0	0	370	CHF	255.00	94'350.00	0.08	a)
CH0007251413	SWISS RE IMMOPLUS	135	0	135	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0009778769	IMMOFONDS	271	0	0	271	CHF	428.00	115'988.00	0.10	a)
CH0012913700	CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT	1'246	0	0	1'246	CHF	186.90	232'877.40	0.20	a)
CH0014420829	UBS PROPERTY FUND SWISS RESIDEN	2'990	0	0	2'990	CHF	67.40	201'526.00	0.17	a)
CH0014420852	UBS PROPERTY FUND LEMAN RESIDEN	1'058	0	0	1'058	CHF	94.30	99'769.40	0.08	a)
CH0014420878	UBS (CH) PROPERTY FUND - SWISS MIX	4'140	0	0	4'140	CHF	106.90	442'566.00	0.38	a)
CH0014420886	UBS PROPERTY FUND SWISS COMMER	1'665	0	0	1'665	CHF	67.30	112'054.50	0.10	a)
CH0014586710	FONDS IMMOBILIER ROMAND	409	0	0	409	CHF	180.00	73'620.00	0.06	a)
CH0026168846	SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTM	400	0	0	400	CHF	165.20	66'080.00	0.06	a)
CH0026465366	UBS PROPERTY FUND DIRECT RESIDE	2'054	0	0	2'054	CHF	14.75	30'296.50	0.03	a)
CH0026725611	BONHOTE - IMMOBILIER	305	8	0	313	CHF	134.70	42'161.10	0.04	a)
CH0031069328	CS REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS	1'323	0	0	1'323	CHF	130.00	171'990.00	0.15	a)
CH0037430946	SWC (CH) REAL ESTATE FUND IFCA FA C	561	0	0	561	CHF	126.20	70'798.20	0.06	a)
CH0100778445	CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	970	0	0	970	CHF	127.50	123'675.00	0.11	a)
CH0124238004	ROTHSCHILD REAL ESTATE SICAV	412	0	0	412	CHF	131.00	53'972.00	0.05	a)
CH0395718866	SCHRODER IMMOPLUS	0	1'080	0	1'080	CHF	155.00	167'400.00	0.14	a)
CH									2'278'286.10	1.94
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden									17'738'639.53	15.11
Strukturierte Produkte									5'946'161.78	5.07
CH0048232224	ZKB TRACKER-ZERTIFIKAT AUF Q-MAT	42'977	39'368	6'239	76'106	CHF	78.13	5'946'161.78	5.08	a)
CH									5'946'161.78	5.07
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen									11'792'477.75	10.05
CH0019509238	SWC (CH) EF GLOBAL FINANCIALS AA C	3'682	0	0	3'682	CHF	876.14	3'225'947.48	2.76	a)
CH0022736166	SWC (CH) EF GLOBAL RESSOURCES AA	1'332	0	1'332	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0022736174	SWC (CH) EF GLOBAL CONSUMERS AA	1'983	0	1'983	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0022736182	SWC (CH) EF GLOBAL INFRASTRUCTUR	3'956	0	3'956	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0039299513	SWC (CH) EF HQ SWITZERLAND NT CHF	1'566	0	1'566	0	CHF	0.00	0.00	0.00	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
		01.10.2017			30.09.2018					
CH0269985369	BB ADAMANT GLOBAL GENERIKA GT C	3'977	0	3'977	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0269987407	BB ADAMANT GLOBAL MEDTECH UND	8'898	0	8'898	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0269987431	BB ADAMANT GLOBAL BIOTECH GT CH	4'447	0	4'447	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0388442359	SWC (CH) EF SMC SWITZERLAND (II) NT	0	56'152	1'694	54'458	CHF	105.72	5'757'299.02	4.91	a)
CH								8'983'246.50	7.65	
LU0180621947	AVIVA-EMERGING MRKTS BD-IUSD	5'494	0	0	5'494	USD	265.77	1'426'287.13	1.23	a)
LU0555020998	NN L-EM MK DB HC-IC	186	0	0	186	USD	7'621.57	1'382'944.12	1.19	a)
LU0637847533	LACUNA SICAV-ASIA PACIF HE-I	217	0	217	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
LU								2'809'231.25	2.39	
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	370	0	0	370	USD	0.00%	0.00	0.00	c)
USD								0.00	0.00	
Derivative Finanzinstrumente								-36'416.97	-0.03	
Futures								0.00	0.00	
12/17	TOPIX INDEX FUTR DEC17	5	1	6	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
12/17	S&P/TSX 60 IX FUT DEC17	-4	4	0	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
12/17	S&P 500 EMINI FUT DEC17	-48	48	0	0	USD	0.00	0.00	0.00	
12/17	MINI MSCI EMG MKT DEC17	126	1	127	0	USD	0.00	0.00	0.00	
12/17	SWISS MID CAP FUT DEC17	20	26	46	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/17	SWISS MKT IX FUTR DEC17	68	10	78	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
12/17	EURO STOXX 50 DEC17	-146	146	0	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
12/17	FTSE 100 IDX FUT DEC17	-44	45	1	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
12/17	ASX SPI 200 INDEX DEC17	-1	1	0	0	AUD	0.00	0.00	0.00	
03/18	TOPIX INDEX FUTR MAR18	0	50	50	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
03/18	S&P/TSX 60 IX FUT MAR18	0	27	27	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
03/18	S&P 500 EMINI FUT MAR18	0	33	33	0	USD	0.00	0.00	0.00	
03/18	MINI MSCI EMG MKT MAR18	0	147	147	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/18	TOPIX INDEX FUTR JUN18	0	34	34	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
06/18	S&P 500 EMINI FUT JUN18	0	32	32	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/18	MINI MSCI EMG MKT JUN18	0	135	135	0	USD	0.00	0.00	0.00	
06/18	S&P/TSX 60 IX FUT JUN18	0	49	49	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
09/18	TOPIX INDEX FUTR SEP18	0	33	33	0	JPY	0.00	0.00	0.00	
09/18	S&P/TSX 60 IX FUT SEP18	0	26	26	0	CAD	0.00	0.00	0.00	
09/18	S&P500 EMINI FUT SEP18	0	23	23	0	USD	0.00	0.00	0.00	
09/18	MINI MSCI EMG MKT SEP18	0	106	106	0	USD	0.00	0.00	0.00	
12/18	TOPIX INDX FUTR DEC18	0	0	2	-2	JPY	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	S&P/TSX 60 IX FUT DEC18	0	0	2	-2	CAD	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	S&P500 EMINI FUT DEC18	0	6	0	6	USD	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	MSCI EMGMKT DEC18	0	55	0	55	USD	0.00	0.00	0.00	a)
03/18	SWISS MKT IX FUTR MAR18	0	76	76	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/18	SWISS MID CAP FUT MAR18	0	25	25	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
03/18	EURO STOXX 50 MAR18	0	131	131	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
06/18	EURO STOXX 50 JUN18	0	152	152	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
09/18	EURO STOXX 50 SEP18	0	130	130	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
12/18	EURO STOXX 50 DEC18	0	0	101	-101	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	DAX INDEX FUTURE DEC18	0	6	0	6	EUR	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	SWISS MKT IX FUTR DEC18	0	2	0	2	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
12/18	SWISS MID CAP FUT DEC18	0	16	0	16	CHF	0.00	0.00	0.00	a)
06/18	SWISS MKT IX FUTR JUN18	0	75	75	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/18	SWISS MID CAP FUT JUN18	0	20	20	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/18	DAX INDEX FUTURE SEP18	0	6	6	0	EUR	0.00	0.00	0.00	
09/18	SWISS MKT IX FUTR SEP18	0	47	47	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
09/18	SWISS MID CAP FUT SEP18	0	16	16	0	CHF	0.00	0.00	0.00	
06/18	FTSE 100 IDX FUT JUN18	0	21	21	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			30.09.2018					
03/18	FTSE 100 IDX FUT MAR18	0	44	44	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
09/18	FTSE 100 IDX FUT SEP18	0	15	15	0	GBP	0.00	0.00	0.00	
12/18	FTSE 100 IDX FUT DEC18	0	0	15	-15	GBP	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte		Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
EUR/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	2'790'656	EUR	2'417'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.10.2017	CAD	990'000	CHF	779'209	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	1'310'216	AUD	1'700'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	2'037'399	USD	2'100'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	409'652	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	6'116'856	GBP	4'660'000	0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	35'231	NZD	50'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	345'996	JPY	40'000'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	3'246'368	USD	3'360'000	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.10.2017	EUR	440'000	CHF	503'151	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.10.2017	CAD	450'000	CHF	348'102	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	232'113	JPY	27'000'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.10.2017	CHF	151'374	AUD	200'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	6'109'703	GBP	4'660'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	2'310'332	EUR	1'977'000	0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	33'862	NZD	50'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.11.2017	CAD	1'440'000	CHF	1'112'666	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	1'444'874	AUD	1'900'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	417'509	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	583'191	JPY	67'000'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	5'392'214	USD	5'460'000	0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 27.11.2017	NZD	50'000	CHF	34'077	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.11.2017	USD	500'000	CHF	498'374	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	2'961'659	EUR	2'550'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.11.2017	CHF	2'987'781	USD	3'000'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.11.2017	AUD	100'000	CHF	75'927	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.11.2017	CAD	150'000	CHF	117'261	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.11.2017	EUR	150'000	CHF	174'023	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.11.2017	USD	1'300'000	CHF	1'291'352	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 22.12.2017	CAD	1'590'000	CHF	1'224'531	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	5'087'234	EUR	4'377'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	1'343'952	AUD	1'800'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	590'384	JPY	67'000'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	6'522'971	USD	6'660'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	6'075'522	GBP	4'660'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	413'936	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 22.12.2017	CHF	3'127'091	CAD	4'100'000	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 22.12.2017	EUR	1'600'000	CHF	1'872'720	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 22.12.2017	JPY	20'000'000	CHF	175'690	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 22.12.2017	USD	6'500'000	CHF	6'378'450	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	415'355	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	6'154'415	GBP	4'660'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	3'245'313	EUR	2'777'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	1'924'078	CAD	2'510'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	1'358'120	AUD	1'800'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	157'346	USD	160'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	409'271	JPY	47'000'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	2'708'269	CAD	3'500'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 30.01.2018	CAD	7'300'000	CHF	5'671'224	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	1'403'934	EUR	1'200'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 30.01.2018	JPY	925'000'000	CHF	8'022'571	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.01.2018	CHF	10'721'260	USD	11'000'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 30.01.2018	GBP	2'520'000	CHF	3'324'838	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 26.02.2018	CAD	1'290'000	CHF	978'292	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 26.02.2018	CHF	2'848'747	GBP	2'140'000	0.00	0.00	

		Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
HKD/CHF	Verfall 26.02.2018	CHF	394'901	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 26.02.2018	JPY	878'000'000	CHF	7'508'911	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 26.02.2018	CHF	4'630'918	EUR	3'977'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.02.2018	CHF	10'447'601	USD	11'160'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 26.02.2018	CAD	200'000	CHF	150'985	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 26.02.2018	EUR	200'000	CHF	231'618	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 26.02.2018	CHF	4'931'798	JPY	580'000'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 26.02.2018	USD	3'200'000	CHF	2'975'840	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 28.02.2018	CHF	1'360'368	AUD	1'800'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 28.02.2018	AUD	4'500'000	CHF	3'348'788	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 28.02.2018	CHF	590'432	AUD	800'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 28.02.2018	CHF	1'392'198	AUD	1'900'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 07.03.2018	AUD	400'000	CHF	289'990	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.03.2018	CHF	7'429'020	USD	7'960'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 27.03.2018	JPY	298'000'000	CHF	2'605'554	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.03.2018	CHF	4'350'794	EUR	3'777'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.03.2018	AUD	1'900'000	CHF	1'389'316	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.03.2018	CAD	1'490'000	CHF	1'092'782	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 27.03.2018	CHF	393'822	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.03.2018	CHF	2'784'951	GBP	2'140'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.03.2018	CHF	1'101'054	AUD	1'500'000	0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 27.03.2018	NOK	21'000'000	CHF	2'512'986	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.03.2018	USD	1'500'000	CHF	1'413'338	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 27.03.2018	CHF	3'235'496	CAD	4'400'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 27.04.2018	AUD	400'000	CHF	291'509	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	2'128'557	CAD	2'910'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	4'411'272	EUR	3'777'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	2'853'519	GBP	2'140'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	6'103'085	USD	6'460'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 27.04.2018	JPY	298'000'000	CHF	2'688'565	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	397'624	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	539'131	JPY	60'000'000	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 27.04.2018	EUR	950'000	CHF	1'118'749	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 27.04.2018	CHF	2'564'065	AUD	3'500'000	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.04.2018	USD	2'000'000	CHF	1'909'300	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 27.04.2018	GBP	1'200'000	CHF	1'611'756	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 27.04.2018	CAD	4'500'000	CHF	3'331'260	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	2'300'243	AUD	3'100'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	4'374'060	USD	4'460'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	412'721	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	3'387'857	EUR	2'827'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 06.06.2018	CAD	1'590'000	CHF	1'210'801	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.06.2018	JPY	238'000'000	CHF	2'143'314	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	1'287'297	GBP	940'000	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 06.06.2018	GBP	830'000	CHF	1'128'307	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 06.06.2018	CHF	3'349'368	EUR	2'800'000	0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 06.06.2018	AUD	1'600'000	CHF	1'193'277	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 06.06.2018	JPY	230'000'000	CHF	2'083'766	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	4'614'612	EUR	4'000'000	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	1'709'997	GBP	1'300'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	490'964	USD	500'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 05.07.2018	JPY	500'000'000	CHF	4'495'405	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	1'127'676	AUD	1'500'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	413'309	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.07.2018	CHF	2'281'305	CAD	3'000'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	3'704'170	EUR	3'200'000	0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 08.08.2018	JPY	150'000'000	CHF	1'342'892	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	785'028	GBP	600'000	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	3'294'990	AUD	4'500'000	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	416'592	HKD	3'300'000	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.08.2018	CHF	8'908'470	USD	9'000'000	0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 08.08.2018	CAD	1'500'000	CHF	1'128'720	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	386'465	GBP	300'000	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 07.09.2018	CHF	1'150'351	EUR	1'000'000	0.00	0.00	

	Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USD/CHF Verfall 07.09.2018	CHF	8'934'003	USD	9'000'000	0.00	0.00	
AUD/CHF Verfall 07.09.2018	CHF	3'304'427	AUD	4'500'000	0.00	0.00	
JPY/CHF Verfall 07.09.2018	CHF	447'003	JPY	50'000'000	0.00	0.00	
CHF/CAD Verfall 07.09.2018	CAD	4'700'000	CHF	3'590'095	0.00	0.00	
USD/CHF Verfall 05.10.2018	CHF	11'635'260	USD	12'000'000	-81'264.95	-0.07	b)
JPY/CHF Verfall 05.10.2018	CHF	435'518	JPY	50'000'000	5'577.58	0.00	b)
GBP/CHF Verfall 05.10.2018	CHF	377'378	GBP	300'000	-4'679.40	0.00	b)
EUR/CHF Verfall 05.10.2018	CHF	1'128'405	EUR	1'000'000	-6'081.20	-0.01	b)
CHF/CAD Verfall 05.10.2018	CAD	4'700'000	CHF	3'455'722	94'950.63	0.08	b)
AUD/CHF Verfall 05.10.2018	CHF	3'134'322	AUD	4'500'000	-44'919.63	-0.04	b)
Devisentermingeschäfte					-36'416.97	-0.03	

Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht	8'887'362.60	7.57
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	67'188'866.65	57.23
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	13'858'877.10	11.81
Strukturierte Produkte	5'946'161.78	5.07
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	14'070'763.85	11.99
Andere Anlagen - Metallkonten	6'983'748.33	5.95
Derivative Finanzinstrumente	-36'416.97	-0.03
Sonstige Vermögenswerte	480'554.91	0.41
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	117'379'918.25	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-40'761.80	
Andere Verbindlichkeiten	-145'892.36	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	117'193'264.09	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	101'064'669.38	86.10
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-36'416.97	-0.03
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

2'313'909.42 1.97

Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte				186'364.29	0.16
FR0000125585	CASINO GUICHARD PERRACHON	800 EUR	36.22	32'874.65	0.03
GB00B1XZS820	ANGLO AMERICAN PLC	6'547 GBP	1'723.00	143'690.32	0.12
US30303M1027	FACEBOOK INC-A	61 USD	164.46	9'799.32	0.01
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte				2'127'545.13	1.81
CH0367206684	0.7500 % SANTAN 0 3/4 06/12/23 EMTN	100 CHF	100.00%	100'000.00	0.09
US05581LAB53	3.8000 % BNP 3.8 01/10/24 REGS	500 USD	97.88%	478'031.27	0.40
US4581X0BT40	3.8750 % IADB 3 7/8 10/28/41 GMTN	200 USD	107.33%	209'683.80	0.18
US465410BG26	5.3750 % ITALY 5 3/8 06/15/33	400 USD	104.46%	408'161.74	0.35
US857524AB80	5.0000 % POLAND 5 03/23/22	250 USD	105.20%	256'903.28	0.22
USP1905CAE05	4.7500 % BRFSBZ 4 3/4 05/22/24 REGS	300 USD	91.23%	267'331.60	0.23
XS0938722666	4.1250 % GLENLN 4 1/8 05/30/23 REGS	300 USD	99.73%	292'257.58	0.25
XS1489184900	1.8750 % GLENLN 1 7/8 09/13/23 EMTN	100 EUR	101.52%	115'175.86	0.10

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Ausgeliehene Effekten - Borger, Gegenparteien, Vermittler

Zürcher Kantonalbank

Umrechnungskurse	AED	1 = CHF	0.26593703
	AUD	1 = CHF	0.70676364
	BRL	1 = CHF	0.24459441
	CAD	1 = CHF	0.75568621
	CNY	1 = CHF	0.14196436
	CZK	100 = CHF	4.40064400
	DKK	100 = CHF	15.21412400
	EUR	1 = CHF	1.13454748
	GBP	1 = CHF	1.27379604
	HKD	100 = CHF	12.48322700
	HUF	100 = CHF	0.35077200
	IDR	= CHF	0.65550000
	JPY	100 = CHF	0.85997300
	KRW	1 = CHF	0.00088059
	MXN	1 = CHF	0.05223739
	MYR	1 = CHF	0.23602755
	NOK	100 = CHF	11.99513700
	PHP	1 = CHF	0.01807880
	PLN	1 = CHF	0.26499552
	QAR	1 = CHF	0.26824111
	RUB	1 = CHF	0.01491410
	SEK	100 = CHF	10.98367300
	SGD	1 = CHF	0.71489735
	THB	100 = CHF	3.02040800
	TRY	1 = CHF	0.16260217
	TWD	100 = CHF	3.19916200
	USD	1 = CHF	0.97680000
	ZAR	1 = CHF	0.06902570

Collateral ausgeliehene Effekten

Collateral in Fondswährung	Aktien	Obligationen
2'837'167.34	0.00 %	100.00 %

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	32'685'797.90	27.89
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	6'394'973.93	5.46
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	2'313'909.42	1.97

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

Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung per 30.09.2018

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

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten:	2'313'909.42
Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten:	0.00
Hinweis auf Soft Commission Agreements:	Ein Teil der Aufträge wird über Gebührenteilungsvereinbarungen (Commission Sharing Agreements) durchgeführt.

Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I - Ambition

Klasse	Periode	PVK	PMF	PAF	max. PVK p.a.	max. VK Zielfonds p.a.
AA 19)	01.10.2017 – 15.10.2017	1.50 %	n/a	n/a	n/a	4.00 %
AA CHF	16.10.2017 – 30.09.2018	1.50 %	1.20 %	0.30 %	2.00 %	4.00 %
CT CHF	16.11.2017 – 30.09.2018	0.81 %	0.51 %	0.30 %	1.30 %	4.00 %

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

Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

TER

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

Ausschüttung des Nettoertrags 2017 / 2018

Ex Datum: 23.01.2019

Zahlbar: 28.01.2019

			Ausschüttung des Ertrags an Anteilscheininhaber mit Domizil			
			in der Schweiz			im Ausland
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto je Anteil	Abzüglich 35 % Eidg. Verrechnungssteuer	Netto je Anteil	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	6.80	2.38	4.42	4.42

Thesaurierung des Nettoertrags 2017 / 2018

Ex Datum: 23.01.2019

Zahlbar: 28.01.2019

				Thesaurierung für Anteilscheininhaber mit Domizil			
				in der Schweiz		im Ausland	
Klasse	Affidavit	Währung	Brutto- Thesaurierung je Anteil	Abzüglich 35 % Eidg. Verrechnungs- steuer	Netto- Thesaurierung je Anteil	Netto- Thesaurierung je Anteil	Barauszahlung je Anteil
CT CHF	Nein	CHF	1.252	0.438	0.814	0.814	0.000

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

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen
- 4) Gemäss Kreisschreiben 24 vom 20.11.2017 und 25 vom 05.03.2009 der Eidgenössischen Steuerverwaltung
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence
- 14) neue Klassenbezeichnung per 16.10.2017 von AA Klasse in AA CHF Klasse
- 19) Änderung Verwaltungskommission in Pauschale Verwaltungskommission im Rahmen der Einführung des neuen Anteilklassenkonzeptes.
- 21) Änderung von Spread auf SSP per 16.10.2017
- 22) Die Abwicklung des Wertpapierleihe-Geschäfts wird nach dem Principal Modell mit der Zürcher Kantonalbank getätigt. Dabei wurde ein marktübliches Fee-Sharing vereinbart

Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Bewertungs-Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing).

Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen.

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

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt (Ziff. 5.2.2) näher definierten Periode.

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

Bericht der Prüfgesellschaft

Als kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft haben wir die beiliegenden Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Portfolio Fund I

mit den Teilvermögen

- Ambition
- Balance
- Focus
- Relax
- Select

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

Verantwortung des Verwaltungsrates der Fondsleitung

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

Verantwortung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

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

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

Prüfungsurteil

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

Berichterstattung aufgrund weiterer gesetzlicher Vorschriften

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

Ernst & Young AG

Sandor Frei
 Zugelassener Revisionsexperte
 (Leitender Revisor)

Daniele Fiasco
 Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 18. Januar 2019