

Swisscanto (CH) Portfolio Fund World 30

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Portfolio Fund World
Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art «Effektenfonds»,
ein Umbrella-Fonds mit mehreren Teilvermögen

Halbjahresbericht per 31. Juli 2015

Inhaltsverzeichnis	Seite
Organisation und Verwaltung	2
Vertriebsorganisation.....	3
Abschlusszahlen	4
Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	15
Pauschale Verwaltungskommission	15
TER.....	15
Erklärung der Fussnoten	15
Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

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

Swisscanto Fondsleitung AG

Zürich, 25.09.2015

Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma: **Swisscanto Fondsleitung AG** (seit 30.6.2015)
 Swisscanto Asset Management AG (bis 30.6.2015)
 Sitz: **Europaallee 39, 8004 Zürich** (seit 20.4.2015)
 Nordring 4, 3000 Bern 25 (bis 20.4.2015)

Verwaltungsrat

Daniel Previdoli, Präsident (seit 25.3.2015)
 Mitglied der Generaldirektion und Leiter Products,
 Services & Direct Banking, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied (seit 25.3.2015)
 Mitglied der Direktion und Leiterin Produktmanagement
 Anlage- & Vorsorgegeschäft, Zürcher Kantonalbank

Christoph Schenk, Mitglied (seit 25.3.2015)
 Mitglied der Direktion und Leiter Investment Solutions,
 Zürcher Kantonalbank

Dr. G. Fischer, Präsident (bis 25.3.2015)
 CEO Swisscanto Holding AG, Bern

H. Frey, Mitglied (bis 25.3.2015)
 Vorsitzender der Geschäftsleitung
 der Swisscanto Asset Management AG, Bern

O. Simeon, Mitglied (bis 25.3.2015)
 Geschäftsführer der Swisscanto Vorsorge AG, Zürich

Geschäftsführung

Hans Frey
 Geschäftsführer (seit 25.3.2015)
 Vorsitzender Leiter des Bereiches «Corporate Services» (bis 25.3.2015)

Bruno Schranz (seit 25.3.2015)
 stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Business Development

André Wirz (seit 25.3.2015)
 Leiter Administration & Operations

Markus Erb (seit 25.3.2015)
 Leiter Legal & Compliance

Andreas Hogg (seit 25.3.2015)
 Leiter Risk, Finance & Services

P. Bänziger (bis 25.3.2015)
 Leiter des Bereiches «Asset Management»

T. Breitenmoser (bis 25.3.2015)
 Leiter des Bereiches «Vertrieb Institutionelle»

C. Racine (bis 25.3.2015)
 Leiter des Bereiches «Vertrieb Kantonalbanken»

Beratender Anlageausschuss

Dr. T. Stucki, Vorsitzender
 Mitglied der Direktion, St. Galler Kantonalbank, St. Gallen

R. Armbruster
 Mitglied der Direktion, Basler Kantonalbank, Basel

M. Baumgartner
 Mitglied der Direktion, Schaffhauser Kantonalbank, Schaffhausen

O. Maillard
 Mitglied der Direktion, Banque Cantonale de Fribourg, Fribourg

C. Schenk
 Mitglied der Direktion, Zürcher Kantonalbank, Zürich

R. Schneider
 Mitglied der Direktion, Berner Kantonalbank, Bern

Zentrale Auftragssammelstelle

Swisscanto Funds Centre Ltd., London

Fondsadministration

Firma:

Swisscanto Fondsleitung AG (seit 30.6.2015)
 Swisscanto Asset Management AG (bis 30.6.2015)
Europaallee 39, 8004 Zürich (seit 20.4.2015)
 Nordring 4, 3000 Bern 25 (bis 20.4.2015)

Sitz:

Depotbank

Banque Cantonale Vaudoise, Lausanne

Prüfgesellschaft

KPMG AG, Zürich

Vertriebsorganisation

Vertrieb Schweiz

Zahl- und Vertriebsstellen

alle Kantonalbanken und
 die Bank Coop AG, Basel

Vertrieb Ausland

Liechtenstein

Zahl- und Vertriebsstelle

Valartis Bank (Liechtenstein) AG
 Schaaner Strasse 27
 FL-9487 Gamprin-Bendern

SWISSCANTO (CH) PORTFOLIO FUND WORLD 30

Übersicht	Rechnungsperiode bis	01.02.2015 31.07.2015	01.02.2014 31.01.2015	01.02.2013 31.01.2014	01.02.2012 31.01.2013
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		44'620'400.49	44'626'466.94	43'926'723.71	46'958'962.28
Klasse A	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		44'567'963.69	44'575'734.82	43'926'723.71	46'958'962.28
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		393'711	402'827	413'897	456'134
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		113.20	110.66	106.13	102.95
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		113.10	110.66	106.04	102.83
Ausschüttung je Anteil		-	1.35	1.40	1.65
Total Expense Ratio (TER)		1.05 %	1.05 %	1.05 %	1.04 %
Klasse P	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		52'436.80	50'732.12		
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		480	480		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		109.24	105.69		
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode nach SSP		109.15	105.69		
Thesaurierung je Anteil		-	1.32		
Total Expense Ratio (TER)		0.52 %	0.51 %		

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

Performance	YTD / 31.07.2015	2014	2013	2012
Klasse A	1.22 %	8.61 %	5.48 %	6.46 %
Klasse P (Lancierung 24.03.2014)	1.63 %	8.03 %	-	-

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

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	31.07.2015	31.01.2015
Bankguthaben auf Sicht	1'797'665.80	1'898'603.14
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	13'965'049.05	13'532'999.11
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	27'145'849.18	27'524'965.59
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	1'359'250.87	1'176'626.61
Sonstige Vermögenswerte	391'572.39	532'905.86
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	44'659'387.29	44'666'100.31
Andere Verbindlichkeiten	-38'986.80	-39'633.37
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	44'620'400.49	44'626'466.94

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse A	Rechnungsperiode	01.02.2015	01.02.2014
		bis	31.07.2015	31.01.2015
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			402'827	413'897
Ausgegebene Anteile			23'340	46'765
Zurückgenommene Anteile			-32'456	-57'835
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			393'711	402'827

Entwicklung der Anzahl Anteile	Klasse P	Rechnungsperiode	01.02.2015	Lancierung 24.03.2014
		bis	31.07.2015	31.01.2015
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode			480	0
Ausgegebene Anteile			0	480
Bestand am Ende der Rechnungsperiode			480	480

Veränderung des Nettofondsvermögens	(konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.02.2015	01.02.2014
		bis	31.07.2015	31.01.2015
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode			44'626'466.94	43'926'723.71
Anlässlich des letzten Jahresabschlusses vorgesehene Ausschüttung			-527'449.05	-562'154.60
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer			-221.14	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr			-1'041'075.58	-1'149'430.60
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung			1'562'679.32	2'411'328.43
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode			44'620'400.49	44'626'466.94

Erfolgsrechnung (konsolidiert)	Rechnungsperiode	01.02.2015	01.02.2014
	bis	31.07.2015	31.01.2015
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		150.31	886.06
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-2'810.63	0.00
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		209'749.28	283'649.53
Erträge der Obligationen, Wandelobligationen und sonstigen Forderungswertpapiere und -rechte		341'175.70	718'471.62
Erträge der Gratisaktien		7'436.45	10'635.95
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		6'184.50	4'189.50
Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds 4)		0.00	1'149.76
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		14'821.25	43'717.18
Total Ertrag		576'706.86	1'062'699.60
Aufwand			
Passivzinsen		0.00	-1.88
Pauschale Verwaltungskommission (gemäss separater Tabelle)		-228'389.50	-456'706.70
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-15'557.92	-51'323.24
Total Aufwand		-243'947.42	-508'031.82
Nettoertrag / Verlust		332'759.44	554'667.78
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		717'980.47	247'653.04
Zahlungen aus Kapitaleinlageprinzip		80'026.27	90'259.97
Einkünfte aus dem Swinging Single Pricing (SSP)		3'872.83	6'996.57
Übertrag von steuerrechtlichem Ausgleich aufgrund von Erträgen aus Zielfonds 4)		0.00	-1'149.76
Realisierter Erfolg		1'134'639.01	898'427.60
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		428'040.31	1'512'900.83
Gesamterfolg		1'562'679.32	2'411'328.43

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 %
		01.02.2015			31.07.2015				
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte									13'965'049.05 31.26
AU000000BHP4	BHP BILLITON LIMITED	600	0	600	0	AUD	0.00	0.00	0.00
AU000000WOW2	WOOLWORTHS LTD	1'060	0	1'060	0	AUD	0.00	0.00	0.00
AU									0.00 0.00
BE0003562700	DELHAIZE GROUP		660	0	660	EUR	82.09	57'531.57	0.13
BE0003793107	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	480	0	220	260	EUR	108.35	29'913.99	0.07
BE									87'445.56 0.20
US20441A1025	CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	2'500	0	2'500	0	USD	0.00	0.00	0.00
BR									0.00 0.00
CA0977512007	BOMBARDIER INC-B	10'000	0	10'000	0	CAD	0.00	0.00	0.00
CA5527041084	MEG ENERGY CORP	850	780	0	1'630	CAD	14.02	16'882.77	0.04
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	1'700	0	0	1'700	CAD	23.17	29'099.33	0.07
CA73755L1076	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	850	0	0	850	CAD	35.58	22'342.56	0.05
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	320	0	0	320	CAD	76.26	18'028.30	0.04
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	1'100	0	0	1'100	CAD	36.84	29'937.83	0.07
CA87971M1032	TELUS CORP		1'650	0	1'650	CAD	44.65	54'426.87	0.12
CA89353D1078	TRANSCANADA CORP		670	0	670	CAD	50.83	25'159.55	0.06
CA									195'877.21 0.45
CH0002497458	SGS SA-REG	13	0	0	13	CHF	1'845.00	23'985.00	0.05
CH0008742519	SWISSCOM AG-REG	150	0	0	150	CHF	562.00	84'300.00	0.19
CH0010532478	ACTELION LTD-REG	778	0	0	778	CHF	142.90	111'176.20	0.25
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	42	0	42	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0011037469	SYNGENTA AG-REG	558	0	0	558	CHF	398.00	222'084.00	0.50
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1'218	0	0	1'218	CHF	294.30	358'457.40	0.80
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	21'320	0	2'000	19'320	CHF	100.40	1'939'728.00	4.34
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	5'584	0	0	5'584	CHF	279.10	1'558'494.40	3.49
CH0012138530	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	10'619	323	0	10'942	CHF	28.48	311'628.16	0.70
CH0012138605	ADECCO SA-REG	829	0	0	829	CHF	80.65	66'858.85	0.15
CH0012214059	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	1'430	0	0	1'430	CHF	67.30	96'239.00	0.22
CH0012221716	ABB LTD-REG	18'330	0	0	18'330	CHF	19.63	359'817.90	0.81
CH0012255151	SWATCH GROUP AG/THE-BR	283	0	0	283	CHF	416.10	117'756.30	0.26
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	311	0	0	311	CHF	228.20	70'970.20	0.16
CH0024638196	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	300	0	0	300	CHF	155.70	46'710.00	0.10
CH0030170408	GEBERIT AG-REG	237	0	237	0	CHF	0.00	0.00	0.00
CH0038863350	NESTLE SA-REG	24'291	0	0	24'291	CHF	73.20	1'778'101.20	3.98
CH0048265513	TRANSOCEAN LTD	2'838	0	0	2'838	CHF	13.28	37'688.64	0.08
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	1'759	0	0	1'759	CHF	53.45	94'018.55	0.21
CH0126881561	SWISS RE AG	2'867	0	0	2'867	CHF	87.00	249'429.00	0.56
CH0210483332	CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	3'823	0	0	3'823	CHF	83.40	318'838.20	0.71
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	29'287	0	0	29'287	CHF	22.25	651'635.75	1.46
IE00BLNN3691	WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	6'942	0	6'942	0	USD	0.00	0.00	0.00
JE00BFNWV485	WOLSELEY PLC	657	0	0	657	GBP	4'256.00	41'937.19	0.09
CH									8'539'853.94 19.11
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2'800	0	2'800	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0005785802	FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	300	0	300	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	395	0	395	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0006048432	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	290	0	290	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	2'100	0	2'100	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0007164600	SAP SE	578	275	0	853	EUR	65.26	59'110.97	0.13
DE0007472060	WIRECARD AG		460	0	460	EUR	36.00	17'586.06	0.04
DE0007664039	VOLKSWAGEN AG-PREF	130	0	0	130	EUR	182.40	25'179.10	0.06
DE0008232125	DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		1'650	0	1'650	EUR	12.35	21'638.29	0.05
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	410	0	410	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG		350	0	350	EUR	149.10	55'413.77	0.12
DE000A1EWWW0	ADIDAS AG	250	0	250	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE000BAY0017	BAYER AG-REG		400	0	400	EUR	134.30	57'043.74	0.13

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.02.2015	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.07.2015	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in %
DE000LED4000	OSRAM LICHT AG		730	0	730	EUR	51.84	40'184.62	0.09
DE000TUAG000	TUI AG-DI	1'000	0	1'000	0	EUR	0.00	0.00	0.00
DE								276'156.55	0.62
DK0060534915	NOVO NORDISK A/S-B	430	0	430	0	DKK	0.00	0.00	0.00
DK								0.00	0.00
ES0124244E34	MAPFRE SA	5'900	0	5'900	0	EUR	0.00	0.00	0.00
ES0173516115	REPSOL SA	1'216	0	1'216	0	EUR	0.00	0.00	0.00
ES								0.00	0.00
FR0000073272	SAFRAN SA		450	0	450	EUR	68.86	32'904.22	0.07
FR0000120271	TOTAL SA	960	0	0	960	EUR	45.08	45'949.31	0.10
FR0000120354	VALLOUREC SA	450	0	450	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000120578	SANOFI	480	0	480	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000120628	AXA SA		2'360	0	2'360	EUR	24.00	60'144.41	0.13
FR0000120693	PERNOD RICARD SA	220	0	220	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE		370	0	370	EUR	63.59	24'984.03	0.06
FR0000125338	CAP GEMINI		360	0	360	EUR	87.05	33'276.93	0.07
FR0000130650	DASSAULT SYSTEMES SA	530	0	530	0	EUR	0.00	0.00	0.00
FR0000130809	SOCIETE GENERALE SA	540	0	0	540	EUR	44.80	25'688.80	0.06
FR0010208488	ENGIE	960	0	0	960	EUR	17.49	17'824.15	0.04
NL0000235190	AIRBUS GROUP SE	425	0	0	425	EUR	64.60	29'153.69	0.07
FR								269'925.54	0.60
GB0000031285	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	3'500	4'900	0	8'400	GBP	364.00	45'857.78	0.10
GB0004544929	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	920	0	920	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0004835483	SABMILLER PLC		520	0	520	GBP	3'364.50	26'239.54	0.06
GB0005405286	HSBC HOLDINGS PLC	1'663	0	1'663	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0006776081	PEARSON PLC	1'830	0	0	1'830	GBP	1'203.00	33'017.87	0.07
GB0007188757	RIO TINTO PLC	980	0	0	980	GBP	2'486.50	36'546.59	0.08
GB0007908733	SSE PLC		1'130	0	1'130	GBP	1'515.00	25'675.77	0.06
GB0008706128	LLOYDS BANKING GROUP PLC	28'000	18'000	0	46'000	GBP	83.20	57'400.21	0.13
GB0008762899	BG GROUP PLC	2'240	1'800	0	4'040	GBP	1'092.50	66'196.52	0.15
GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	2'000	0	2'000	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	500	280	0	780	GBP	4'320.00	50'537.14	0.11
GB0031348658	BARCLAYS PLC	8'500	6'000	0	14'500	GBP	288.95	62'838.10	0.14
GB0031638363	INTERTEK GROUP PLC	500	0	0	500	GBP	2'447.00	18'350.01	0.04
GB0033986497	ITV PLC		8'860	0	8'860	GBP	280.70	37'299.97	0.08
GB00B18V8630	PENNON GROUP PLC	2'200	0	0	2'200	GBP	815.50	26'907.85	0.06
GB00B1YW4409	3I GROUP PLC	3'200	0	3'200	0	GBP	0.00	0.00	0.00
GB00BDZT6P94	MERLIN ENTERTAINMENT		4'700	0	4'700	GBP	415.50	29'288.78	0.07
GB00BH4HKS39	VODAFONE GROUP PLC	12'457	0	3'680	8'777	GBP	241.85	31'836.44	0.07
GB00BMJ6DW54	INFORMA PLC	2	0	2	0	GBP	0.00	0.00	0.00
JE00B783TY65	DELPHI AUTOMOTIVE PLC		740	0	740	USD	78.08	55'531.59	0.12
JE00B8KF9B49	WPP PLC	1'214	0	0	1'214	GBP	1'470.00	26'765.07	0.06
NL0000009355	UNILEVER NV-CVA	538	980	0	1'518	EUR	40.81	65'782.50	0.15
GB								696'071.73	1.55
HK0000069689	AIA GROUP LTD	8'250	0	2'000	6'250	HKD	50.50	39'129.96	0.09
HK0027032686	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2'900	0	2'900	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK2388011192	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	9'200	0	9'200	0	HKD	0.00	0.00	0.00
HK								39'129.96	0.09
IE0001827041	CRH PLC	900	0	900	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	450	0	450	0	USD	0.00	0.00	0.00
IE00B4Q5ZN47	JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	200	140	0	340	USD	192.24	62'819.03	0.14
IE00BTN1Y115	MEDTRONIC PLC	1'121	0	1'121	0	USD	0.00	0.00	0.00
JE00B2QKY057	SHIRE PLC	600	0	230	370	GBP	5'680.00	31'519.72	0.07
IE								94'338.75	0.21

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd. 01.02.2015	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd. 31.07.2015	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in %
IT0004618465	ENEL GREEN POWER SPA	11'000	0	11'000	0	EUR	0.00	0.00	0.00
IT								0.00	0.00
JP3119600009	AJINOMOTO CO INC	2'000	0	2'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3162600005	SMC CORP	100	0	100	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3236200006	KEYENCE CORP	100	0	0	100	JPY	62'500.00	48'483.63	0.11
JP3294460005	INPEX CORP	2'000	0	2'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3404600003	SUMITOMO CORP	2'000	0	2'000	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3502200003	DAIWA SECURITIES GROUP INC	3'000	3'000	0	6'000	JPY	963.70	44'854.72	0.10
JP3633400001	TOYOTA MOTOR CORP	900	0	0	900	JPY	8'253.00	57'619.49	0.13
JP3672400003	NISSAN MOTOR CO LTD	2'300	0	2'300	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3684000007	NITTO DENKO CORP	500	0	500	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3705200008	JAPAN AIRLINES CO LTD	1'000	0	0	1'000	JPY	4'680.00	36'304.54	0.08
JP3726800000	JAPAN TOBACCO INC	900	0	900	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3783600004	EAST JAPAN RAILWAY CO		400	0	400	JPY	12'250.00	38'011.16	0.09
JP3788600009	HITACHI LTD	5'000	0	0	5'000	JPY	804.40	31'200.18	0.07
JP3802400006	FANUC CORP	200	0	0	200	JPY	20'680.00	32'084.52	0.07
JP3818000006	FUJITSU LTD		4'000	0	4'000	JPY	650.60	20'187.81	0.05
JP3854600008	HONDA MOTOR CO LTD	1'100	700	0	1'800	JPY	3'979.50	55'566.89	0.12
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	900	500	0	1'400	JPY	5'544.00	60'209.68	0.13
JP3902900004	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	5'700	0	5'700	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP3914400001	MURATA MANUFACTURING CO LTD	500	0	500	0	JPY	0.00	0.00	0.00
JP								424'522.62	0.95
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1'000	0	0	1'000	GBP	1'840.00	27'596.26	0.06
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	892	0	0	892	EUR	2'618.00	24'797.42	0.06
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	6'700	0	6'700	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0000009538	KONINKLIJKE PHILIPS NV	1'250	0	1'250	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0000009827	KONINKLIJKE DSM NV	300	0	300	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0000303709	AEGON NV	3'850	0	0	3'850	EUR	7.00	28'633.79	0.06
NL0010273215	ASML HOLDING NV	430	190	0	620	EUR	90.64	59'673.79	0.13
NL0010672325	KONINKLIJKE AHOLD NV	1'716	0	1'716	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL001103120X	MYLAN NV		505	505	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL								140'701.26	0.31
NO0010063308	TELENOR ASA		2'560	0	2'560	NOK	179.20	54'239.72	0.12
NO0010208051	YARA INTERNATIONAL ASA	500	0	500	0	NOK	0.00	0.00	0.00
NO								54'239.72	0.12
SE0000148884	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	2'100	0	2'100	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0000427361	NORDEA BANK AB	2'400	0	2'400	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE0000667891	SANDVIK AB	1'700	0	1'700	0	SEK	0.00	0.00	0.00
SE								0.00	0.00
SG1L01001701	DBS GROUP HOLDINGS LTD	2'000	0	0	2'000	SGD	20.18	28'349.04	0.06
SG								28'349.04	0.06
BMG169621056	BUNGE LTD	350	0	350	0	USD	0.00	0.00	0.00
NL0009434992	LYONDELLBASELL INDU-CL A		370	0	370	USD	93.83	33'366.60	0.07
NL0011031208	MYLAN NV		505	505	0	USD	0.00	0.00	0.00
US00101J1060	ADT CORP/THE	1'027	0	1'027	0	USD	0.00	0.00	0.00
US00846U1016	AGILENT TECHNOLOGIES INC	620	0	620	0	USD	0.00	0.00	0.00
US0091581068	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	330	0	330	0	USD	0.00	0.00	0.00
US0200021014	ALLSTATE CORP	630	0	155	475	USD	68.95	31'477.23	0.07
US02005N1000	ALLY FINANCIAL INC		1'465	0	1'465	USD	22.77	32'060.42	0.07
US0231351067	AMAZON.COM INC	145	0	45	100	USD	536.15	51'529.38	0.12
US02376R1023	AMERICAN AIRLINES GROUP INC	800	0	800	0	USD	0.00	0.00	0.00
US0268747849	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1'000	0	0	1'000	USD	64.12	61'625.73	0.14
US03073E1055	AMERISOURCEBERGEN CORP	340	0	340	0	USD	0.00	0.00	0.00
US0325111070	ANADARKO PETROLEUM CORP	380	0	0	380	USD	74.35	27'153.96	0.06
US03662Q1058	ANSYS INC	290	0	290	0	USD	0.00	0.00	0.00
US0378331005	APPLE INC	1'050	0	465	585	USD	121.30	68'200.14	0.15
US0572241075	BAKER HUGHES INC	725	0	725	0	USD	0.00	0.00	0.00
US0605051046	BANK OF AMERICA CORP		3'690	0	3'690	USD	17.88	63'410.69	0.14
US0846707026	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	100	0	100	0	USD	0.00	0.00	0.00
US09062X1037	BIOGEN INC		70	0	70	USD	318.78	21'446.56	0.05
US1101221083	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	660	0	660	0	USD	0.00	0.00	0.00
US1252691001	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		525	0	525	USD	59.20	29'870.99	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 %
		01.02.2015			31.07.2015				
US1255818015	CIT GROUP INC	570	0	570	0	USD	0.00	0.00	0.00
US12572Q1058	CME GROUP INC	480	0	480	0	USD	0.00	0.00	0.00
US1266501006	CVS HEALTH CORP	570	0	0	570	USD	112.47	61'614.10	0.14
US1313473043	CALPINE CORP	1'000	0	0	1'000	USD	18.30	17'588.13	0.04
US14040H1059	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	400	300	0	700	USD	81.30	54'696.20	0.12
US14149Y1082	CARDINAL HEALTH INC		420	0	420	USD	84.98	34'303.20	0.08
US1510201049	CELGENE CORP	450	0	0	450	USD	131.25	56'764.97	0.13
US1667641005	CHEVRON CORP	249	210	0	459	USD	88.48	39'032.50	0.09
US17275R1023	CISCO SYSTEMS INC	1'335	0	0	1'335	USD	28.42	36'464.81	0.08
US1729674242	CITIGROUP INC	1'340	0	220	1'120	USD	58.46	62'928.21	0.14
US1924461023	COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		1'290	0	1'290	USD	63.10	78'232.58	0.18
US1941621039	COLGATE-PALMOLIVE CO	440	0	0	440	USD	68.02	28'764.57	0.06
US20030N1019	COMCAST CORP-CLASS A		1'030	0	1'030	USD	62.41	61'781.72	0.14
US2003401070	COMERICA INC	450	0	450	0	USD	0.00	0.00	0.00
US20825C1045	CONOCOPHILLIPS	655	0	290	365	USD	50.34	17'659.35	0.04
US21036P1084	CONSTELLATION BRANDS INC-A		310	0	310	USD	120.02	35'758.88	0.08
US22160K1051	COSTCO WHOLESALE CORP	200	0	200	0	USD	0.00	0.00	0.00
US2358511028	DANAHER CORP	560	0	0	560	USD	91.56	49'279.06	0.11
US25179M1036	DEVON ENERGY CORP	600	220	0	820	USD	49.42	38'948.00	0.09
US2546871060	WALT DISNEY CO/THE	665	0	350	315	USD	120.00	36'329.58	0.08
US25470F1049	DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	380	0	0	380	USD	33.02	12'059.50	0.03
US25470F3029	DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	380	0	0	380	USD	30.30	11'066.11	0.02
US2686481027	EMC CORP/MA	950	0	0	950	USD	26.89	24'551.78	0.05
US2786421030	EBAY INC	750	340	0	1'090	USD	28.12	29'458.48	0.07
US2788651006	ECOLAB INC		250	0	250	USD	115.81	27'826.25	0.06
US29444U7000	EQUINIX INC	205	0	205	0	USD	0.00	0.00	0.00
US30161N1019	EXELON CORP		760	0	760	USD	32.09	23'439.69	0.05
US30231G1022	EXXON MOBIL CORP	595	0	300	295	USD	79.21	22'457.98	0.05
US30303M1027	FACEBOOK INC-A		380	0	380	USD	94.01	34'334.14	0.08
US31428X1063	FEDEX CORP	180	0	180	0	USD	0.00	0.00	0.00
US3167731005	FIFTH THIRD BANCORP	1'540	0	0	1'540	USD	21.07	31'185.58	0.07
US34354P1057	FLOWERVE CORP		480	0	480	USD	46.99	21'677.80	0.05
US3696041033	GENERAL ELECTRIC CO	3'030	0	735	2'295	USD	26.10	57'569.41	0.13
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	460	0	180	280	USD	117.86	31'717.07	0.07
US38259P5089	GOOGLE INC-CL A	83	0	33	50	USD	657.50	31'596.16	0.07
US38259P7069	GOOGLE INC-CL C	83	0	32	51	USD	625.61	30'664.96	0.07
US40412C1018	HCA HOLDINGS INC		385	0	385	USD	93.01	34'415.89	0.08
US4370761029	HOME DEPOT INC		500	0	500	USD	117.03	56'238.77	0.13
US4385161066	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	420	170	0	590	USD	105.05	59'568.50	0.13
US4581401001	INTEL CORP	1'900	0	1'050	850	USD	28.95	23'650.27	0.05
US4592001014	INTL BUSINESS MACHINES CORP	350	0	350	0	USD	0.00	0.00	0.00
US46625H1005	JPMORGAN CHASE & CO	1'029	0	1'029	0	USD	0.00	0.00	0.00
US4781601046	JOHNSON & JOHNSON	310	220	0	530	USD	100.21	51'045.27	0.11
US4783661071	JOHNSON CONTROLS INC	905	0	0	905	USD	45.56	39'627.88	0.09
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	310	0	310	0	USD	0.00	0.00	0.00
US49456B1017	KINDER MORGAN INC	770	0	770	0	USD	0.00	0.00	0.00
US50540R4092	LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	340	0	0	340	USD	127.29	41'595.06	0.09
US5184391044	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	320	0	320	0	USD	0.00	0.00	0.00
US55616P1049	MACY'S INC	431	0	431	0	USD	0.00	0.00	0.00
US5658491064	MARATHON OIL CORP	740	0	740	0	USD	0.00	0.00	0.00
US56585A1025	MARATHON PETROLEUM CORP		650	0	650	USD	54.67	34'153.17	0.08
US5801351017	MCDONALD'S CORP	343	0	0	343	USD	99.86	32'919.58	0.07
US5828391061	MEAD JOHNSON NUTRITION CO		400	0	400	USD	88.39	33'980.65	0.08
US58933Y1055	MERCK & CO. INC.	1'300	0	290	1'010	USD	58.96	57'233.12	0.13
US5949181045	MICROSOFT CORP	810	0	810	0	USD	0.00	0.00	0.00
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	1'100	690	0	1'790	USD	18.51	31'844.03	0.07
US61166W1018	MONSANTO CO	385	0	95	290	USD	101.89	28'398.68	0.06
US6174464486	MORGAN STANLEY	1'000	0	0	1'000	USD	38.84	37'329.12	0.08
US6285301072	MYLAN INC	505	0	505	0	USD	0.00	0.00	0.00
US6293775085	NRG ENERGY INC		1'000	0	1'000	USD	22.45	21'576.70	0.05
US67020Y1001	NUANCE COMMUNICATIONS INC	1'100	0	1'100	0	USD	0.00	0.00	0.00
US68389X1054	ORACLE CORP	1'695	0	990	705	USD	39.94	27'062.37	0.06
US6907421019	OWENS CORNING	580	0	580	0	USD	0.00	0.00	0.00
US6934751057	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		680	0	680	USD	98.18	64'165.34	0.14

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in %	
		01.02.2015			31.07.2015					
US70450Y1038	PAYPAL HOLDINGS INC		1'090	0	1'090	USD	38.70	40'542.08	0.09	
US7134481081	PEPSICO INC	500	0	200	300	USD	96.35	27'780.60	0.06	
US7170811035	PFIZER INC	872	830	0	1'702	USD	36.06	58'986.67	0.13	
US7181721090	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	498	0	140	358	USD	85.53	29'428.63	0.07	
US74005P1049	PRAXAIR INC		440	0	440	USD	114.14	48'267.98	0.11	
US74144T1088	T ROWE PRICE GROUP INC	460	0	460	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7427181091	PROCTER & GAMBLE CO/THE	419	0	419	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7458671010	PULTEGROUP INC	1'400	0	0	1'400	USD	20.72	27'879.59	0.06	
US7475251036	QUALCOMM INC	768	0	0	768	USD	64.39	47'527.86	0.11	
US74762E1029	QUANTA SERVICES INC	865	0	865	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US7841171033	SEI INVESTMENTS COMPANY	680	0	0	680	USD	53.31	34'840.64	0.08	
US78486Q1013	SVB FINANCIAL GROUP		270	0	270	USD	143.10	37'134.02	0.08	
US80004C1018	SANDISK CORP		315	315	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8168511090	SEMPRA ENERGY	229	0	0	229	USD	101.78	22'400.95	0.05	
US8475601097	SPECTRA ENERGY CORP	635	0	635	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8589121081	STERICYCLE INC	260	0	0	260	USD	140.97	35'226.43	0.08	
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		490	0	490	USD	139.53	65'710.12	0.15	
US88579Y1010	3M CO	355	0	180	175	USD	151.34	25'454.25	0.06	
US8872281048	TIME INC	96	0	96	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US8873173038	TIME WARNER INC	770	0	420	350	USD	88.04	29'615.34	0.07	
US8894781033	TOLL BROTHERS INC		810	0	810	USD	38.92	30'298.87	0.07	
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	550	0	550	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US89469A1043	TREEHOUSE FOODS INC		320	0	320	USD	81.96	25'206.96	0.06	
US9029733048	US BANCORP	1'120	0	425	695	USD	45.21	30'198.68	0.07	
US9078181081	UNION PACIFIC CORP	468	0	225	243	USD	97.59	22'791.88	0.05	
US9113121068	UNITED PARCEL SERVICE-CL B		260	0	260	USD	102.36	25'578.33	0.06	
US9130171096	UNITED TECHNOLOGIES CORP	347	150	0	497	USD	100.31	47'914.75	0.11	
US9139031002	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		314	0	314	USD	145.23	43'828.29	0.10	
US92343V1044	VERIZON COMMUNICATIONS INC	300	300	0	600	USD	46.79	26'981.92	0.06	
US92345Y1064	VERISK ANALYTICS INC	525	0	525	0	USD	0.00	0.00	0.00	
US9290891004	VOYA FINANCIAL INC		740	0	740	USD	46.95	33'391.50	0.07	
US9311421039	WAL-MART STORES INC	672	0	0	672	USD	71.98	46'488.95	0.10	
US9497461015	WELLS FARGO & CO	1'380	0	800	580	USD	57.87	32'258.94	0.07	
US9856P1021	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		280	0	280	USD	104.07	28'006.07	0.06	
US								3'118'437.17	6.99	
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte									27'145'849.18	60.79
AU3CB0191278	5.5000 % RENTEN 5 1/2 03/09/20 MTN	100	0	0	100	AUD	112.08%	79'100.72	0.18	
AUD								79'100.72	0.18	
CA68323AAW41	3.1500 % ONT 3.15 06/02/22	100	0	0	100	CAD	109.30%	80'747.32	0.18	
CAD								80'747.32	0.18	
CH0008435569	4.0000 % SWISS 4 02/11/23	2'000	0	0	2'000	CHF	132.36%	2'647'200.00	5.93	
CH0008805449	0.0000 % IBRD 0 11/26/21	800	0	0	800	CHF	101.20%	809'600.00	1.81	
CH0011074785	4.5000 % ZKB 4 1/2 08/14/15 95	1'200	0	0	1'200	CHF	100.22%	1'202'640.00	2.69	
CH0015803239	3.5000 % SWISS 3 1/2 04/08/33	1'900	0	0	1'900	CHF	152.45%	2'896'550.00	6.49	
CH0016070341	2.7500 % EUROF 2 3/4 06/19/15	100	0	100	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0016253640	2.8750 % PFBKOS 2 7/8 07/21/17 EMTN	500	0	500	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0020632144	2.8750 % OKB 2 7/8 02/25/30	300	0	0	300	CHF	131.85%	395'550.00	0.89	
CH0020810468	3.0000 % KBLUZE 3 03/11/25	400	0	0	400	CHF	124.75%	499'000.00	1.12	
CH0022061508	2.3750 % EUROF 2 3/8 08/03/20	400	0	0	400	CHF	112.70%	450'800.00	1.01	
CH0025896942	3.1250 % EIB 3 1/8 06/30/36 EMTN	400	0	0	400	CHF	147.55%	590'200.00	1.32	
CH0026302304	3.3750 % ABNAV 3 3/8 08/15/31 EMTN	100	0	0	100	CHF	140.75%	140'750.00	0.32	
CH0031026476	3.0000 % GE 3 06/15/15 EMTN	100	0	100	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0037181689	2.3750 % KUNTA 2 3/8 03/11/16 EMTN	500	0	0	500	CHF	102.00%	510'000.00	1.14	
CH0039139263	4.5000 % ROSW 4 1/2 03/23/17	600	0	0	600	CHF	108.05%	648'300.00	1.45	
CH0042785128	3.5000 % DANBNK 3 1/2 07/02/15 EMTN	400	0	400	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0044004684	3.5000 % KBAARG 3 1/2 08/14/17	400	0	0	400	CHF	107.80%	431'200.00	0.97	
CH0045156335	4.0000 % SCMNVS 4 09/17/15	100	0	0	100	CHF	100.55%	100'550.00	0.23	
CH0103164361	3.2500 % COOPSW 3 1/4 07/31/15	800	0	800	0	CHF	0.00%	0.00	0.00	
CH0103165020	3.0000 % ALPHSW 3 11/25/19	400	0	0	400	CHF	107.15%	428'600.00	0.96	
CH0109361813	2.2500 % DANBNK 2 1/4 09/12/17 EMTN	500	0	0	500	CHF	105.60%	528'000.00	1.18	
CH0110118566	2.1250 % KWLILI 2 1/8 03/10/17	1'000	0	0	1'000	CHF	103.20%	1'032'000.00	2.31	
CH0112134751	2.2500 % NDASS 2 1/4 05/06/16 EMTN	300	0	0	300	CHF	102.20%	306'600.00	0.69	
CH0112403875	2.2500 % SGKNSW 2 1/4 05/11/20	300	0	0	300	CHF	111.30%	333'900.00	0.75	

ISIN	Bezeichnung	Anzahl / Nominal in Tsd.	Käufe / Zugänge 2)	Verkäufe / Abgänge 3)	Anzahl / Nominal in Tsd.	Wäh- rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in %
		01.02.2015			31.07.2015				
CH0112933483	2.2500 % BERN 2 1/4 05/31/23	400	0	0	400	CHF	116.70%	466'800.00	1.05
CH0113648494	2.3750 % LHNIX 2 3/8 06/07/16 EMTN	400	0	0	400	CHF	101.82%	407'280.00	0.91
CH0116712644	2.0000 % RAIFFS 2 09/21/23	500	0	0	500	CHF	113.20%	566'000.00	1.27
CH0117606472	2.0000 % MIGROS 2 05/03/17	400	0	0	400	CHF	104.20%	416'800.00	0.93
CH0119015086	2.0000 % PFZENT 2 10/30/25 405	900	0	0	900	CHF	116.75%	1'050'750.00	2.35
CH0124853604	2.6250 % SGSNVX 2 5/8 03/08/19	500	0	0	500	CHF	109.15%	545'750.00	1.22
CH0136847156	1.7500 % PFZENT 1 3/4 09/02/26 413	800	0	0	800	CHF	114.24%	913'920.00	2.05
CH0139265000	2.2500 % ABBNVX 2 1/4 10/11/21	300	0	0	300	CHF	111.65%	334'950.00	0.75
CH0144934319	2.1250 % SRENVX 2 1/8 09/22/17	300	0	0	300	CHF	104.65%	313'950.00	0.70
CH0147028200	2.1250 % ADENVX 2 1/8 02/08/16	300	0	0	300	CHF	101.11%	303'330.00	0.68
CH0181379774	2.1250 % SLOVAK 2 1/8 04/25/18	500	0	0	500	CHF	106.55%	532'750.00	1.19
CH0181932952	1.2500 % TESSIN 1 1/4 06/11/27	300	0	0	300	CHF	107.45%	322'350.00	0.72
CH0184043542	1.5000 % PSHYPO 1 1/2 04/27/27 566		500	0	500	CHF	111.42%	557'100.00	1.25
CH0193395537	1.2500 % NEUNBG 1 1/4 09/24/27	500	0	0	500	CHF	108.75%	543'750.00	1.22
CH0194273204	1.3750 % PSHYPO 1 3/8 09/20/29 574		500	0	500	CHF	110.10%	550'500.00	1.23
CH0199419992	1.3750 % GENCTY 1 3/8 11/19/29	500	0	0	500	CHF	111.15%	555'750.00	1.24
CH0199543569	1.2500 % ZURICH 1 1/4 12/03/32	300	0	0	300	CHF	109.70%	329'100.00	0.74
CH0212459561	1.7500 % GENEVA 1 3/4 05/24/34	400	0	0	400	CHF	116.75%	467'000.00	1.05
CH0287817859	0.8750 % COOPSW 0 7/8 07/31/24		700	0	700	CHF	101.95%	713'650.00	1.60
CHF								23'842'920.00	53.41
DE000A0E97W2	3.5000 % LBANK 3 1/2 07/04/16 EMTN	50	0	0	50	EUR	103.30%	54'844.61	0.12
NL0000122489	5.2500 % INTNED 5 1/4 06/07/19 EMTN	100	0	0	100	EUR	116.41%	123'613.54	0.28
XS0219724878	4.0000 % EIB 4 10/15/37 INTL	400	0	0	400	EUR	148.58%	631'083.05	1.41
XS0231636753	3.1250 % ASFING 3 1/8 10/06/15 EMTN	50	0	0	50	EUR	100.56%	53'390.37	0.12
XS0416848363	4.3750 % STLNO 4 3/8 03/11/15 EMTN	100	0	100	0	EUR	0.00%	0.00	0.00
XS0426090485	4.3750 % RABOBK 4 3/8 05/05/16 EMTN	400	0	0	400	EUR	103.22%	438'417.06	0.98
XS0874839086	1.6250 % GE 1 5/8 03/15/18 EMTN	300	0	0	300	EUR	103.09%	328'389.11	0.74
EUR								1'629'737.74	3.65
XS0138037733	6.0000 % KFW 6 12/07/28 EXCH	110	0	0	110	GBP	142.06%	234'367.21	0.52
XS0200950326	4.8750 % KFW 4 7/8 03/15/37 EMTN	50	0	0	50	GBP	137.34%	102'992.53	0.23
XS0225051811	4.6250 % UKRAIL 4 5/8 07/21/20 EMTN	50	0	0	50	GBP	114.41%	85'795.86	0.19
GBP								423'155.60	0.94
XS0159205995	1.7000 % DBJJP 1.7 09/20/22 INTL	10'000	0	10'000	0	JPY	0.00%	0.00	0.00
JPY								0.00	0.00
NO0010429913	4.5000 % NGB 4 1/2 05/22/19 473		2'500	0	2'500	NOK	113.85%	336'526.71	0.75
NOK								336'526.71	0.75
SE0003784461	3.5000 % SGB 3 1/2 06/01/22 #1054 1054	600	0	0	600	SEK	120.96%	81'338.01	0.18
SEK								81'338.01	0.18
US298785DV50	4.8750 % EIB 4 7/8 02/15/36	100	0	0	100	USD	125.78%	120'889.08	0.27
US500769BP83	5.1250 % KFW 5 1/8 03/14/16	300	0	0	300	USD	102.90%	296'677.15	0.66
XS0043037505	7.3750 % AFDB 7 3/8 04/06/23	200	0	0	200	USD	132.53%	254'756.85	0.57
USD								672'323.08	1.50
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen								1'359'250.87	3.05
CH0018712999	SWC (CH) EF SMALL & MID CAPS SWIT 3'990		0	0	3'990	CHF	277.07	1'105'509.30	2.48
CH								1'105'509.30	2.48
LU0866300790	SWC (LU) EF SMALL & MID CAPS JAPAN 1'700		0	0	1'700	JPY	19'241.00	253'741.57	0.57
LU								253'741.57	0.57
Nicht kotierte Wertpapiere									
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte								0.00	0.00
CA1488871023	CATAMARAN CORP	650	0	650	0	CAD	0.00	0.00	0.00
US50076Q1067	KRAFT FOODS GROUP INC	366	0	366	0	USD	0.00	0.00	0.00
US								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 %
		01.02.2015			31.07.2015				
Bezugsrechte								0.00	0.00
CH0271429679	CREDIT SUISSE GR-ENT SHRS		10'619	10'619	0	CHF	0.00	0.00	0.00
FR0012726487	TOTAL SA-SCRIP		960	0	960	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0010866638	UNILEVER DRIP RIGHT		538	538	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0010866661	ROYAL DUTCH SHELL A RTS		1'000	1'000	0	GBP	0.00	0.00	0.00
NL0010866661	ROYAL DUTCH SHELL A RTS		892	892	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0010866687	AEGON NV - SCRIP		3'850	3'850	0	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0011182787	UNILEVER NV-RTS		1'518	0	1'518	EUR	0.00	0.00	0.00
NL0011279476	ROYAL DUTCH SHELL -SCRIP A		1'000	0	1'000	GBP	0.00	0.00	0.00
NL0011279476	ROYAL DUTCH SHELL -SCRIP A		892	0	892	EUR	0.00	0.00	0.00
Diverse								0.00	0.00

Derivative Finanzinstrumente

Futures								0.00	0.00
03/15	SWISS MKT IX FUTR MAR15 - Short	-15	0	15	0	CHF	0.00	0.00	0.00
03/15	EURO STOXX 50 MAR15 - Long	35	0	35	0	EUR	0.00	0.00	0.00
03/15	FTSE 100 IDX FUT MAR15 - Short	-1	0	1	0	GBP	0.00	0.00	0.00
06/15	NIKKEI 225 (SGX) JUN15 - Long		4	4	0	JPY	0.00	0.00	0.00
06/15	SWISS MKT IX FUTR JUN15 - Short		24	24	0	CHF	0.00	0.00	0.00
06/15	EURO STOXX 50 JUN15 - Long		40	40	0	EUR	0.00	0.00	0.00
09/15	NIKKEI 225 (SGX) SEP15 - Long		4	0	4	JPY	0.00	0.00	0.00
09/15	SWISS MKT IX FUTR SEP15 - Short		33	3	-30	CHF	0.00	0.00	0.00
09/15	EURO STOXX 50 SEP15 - Long		40	0	40	EUR	0.00	0.00	0.00

Vermögensaufstellung

Bankguthaben auf Sicht		1'797'665.80	4.03
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte		13'965'049.05	31.26
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte		27'145'849.18	60.79
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'359'250.87	3.04
Sonstige Vermögenswerte		391'572.39	0.88
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		44'659'387.29	100.00
Andere Verbindlichkeiten		-38'986.80	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		44'620'400.49	

Umrechnungskurse	AUD	1 = CHF	0.70578379
	CAD	1 = CHF	0.73876782
	DKK	100 = CHF	14.23103400
	EUR	1 = CHF	1.06187162
	GBP	1 = CHF	1.49979655
	HKD	100 = CHF	12.39761100
	JPY	100 = CHF	0.77573800
	NOK	100 = CHF	11.82332100
	SEK	100 = CHF	11.20764000
	SGD	1 = CHF	0.70240444
	USD	1 = CHF	0.96110000

Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Ge- schäfts- art	Bezeichnung					Marktrisiko				Kreditrisiko		Währungsrisiko	
	Verfall	Kontrakt- grösse	Wäh- rung	Betrag/ Anzahl	Strike	Aktienkursänderungsrisiko		Zinsänderungsrisiko		CHF	5)	CHF	5)
						CHF	5)	CHF	5)				
engagement-erhöhend													
FI	EURO STOXX 50 SEP15					1'528'245.64	3.42	0.00	0.00	0.00	0.00	1'528'245.64	3.42
	18.09.15	10	EUR	40									
FI	NIKKEI 225 (SGX) SEP15					318'750.74	0.71	0.00	0.00	0.00	0.00	318'750.74	0.71
	11.09.15	500	JPY	4									
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)						1'846'996.38	4.14	0.00	0.00	0.00	0.00	1'846'996.38	4.14

Ge- schäfts- art	Bezeichnung					Marktrisiko				Kreditrisiko		Währungsrisiko	
	Verfall	Kontrakt- grösse	Wäh- rung	Betrag/ Anzahl	Strike	Aktienkursänderungsrisiko		Zinsänderungsrisiko		CHF	5)	CHF	5)
						CHF	5)	CHF	5)				
engagement-reduzierend													
FI	SWISS MKT IX FUTR SEP15					2'823'000.00	6.33	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	18.09.15	10	CHF	30									
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)						2'823'000.00	6.33	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

Geschäftsart FI (Indexfutures) OI (Indexoptionen) DT (Devisentermingeschäfte) SW (Swaps)
 FT (Zinsfutures) OA (Aktienoptionen) WA (Aktienwarrants)

Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten:	0.00
Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten:	0.00
Höhe des Kontos der zur Wiederanlage zurückbehaltenen Erträge:	0.00

Hinweis auf Soft Commission Agreements:

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

Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Fondsname	Klasse	PVK	davon seit 03.01.2013	
			PMF	PAF
Swisscanto (CH) Portfolio Fund World 30	A	1.05%	0.90%	0.15%
	P	0.50%	0.40%	0.10%

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

TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der Swiss Funds Association SFA am 16. Mai 2008 herausgegeben wurden, ermittelt.

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

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock- / Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften
- 5) In Prozent des Nettofondsvermögens
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence

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 in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellen Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, 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 sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit des Teilvermögens gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des jeweiligen Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert des Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 1% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/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 Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Prospekt näher definierten Periode.
8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.