

SWISSCANTO (CH) IPF III VORSORGE FONDS 75 PASSIV

Jahresbericht per 30.09.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund III (IPF III)
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

| Klasse | Valor | Währung |
|---------------|--------------|----------------|
| NT CHF | 51215777 | CHF |
| VT CHF | 51196141 | CHF |

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Januar 2025

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund III (IPF III),

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Index Equity Fund MSCI® World ex Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 45 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 75 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 95 Passiv

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, 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), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag.



Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung der Jahresrechnungen in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung von Jahresrechnungen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnungen als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnungen getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilagen

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, 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)

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|----|---|----|
| 1 | Organisation und Verwaltung | 2 |
| 2 | Vertriebsorganisation | 3 |
| 3 | Abschlusszahlen | 4 |
| 4 | Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I | 12 |
| 5 | Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung | 12 |
| 6 | Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte | 12 |
| 7 | Pauschale Verwaltungskommission | 13 |
| 8 | Benchmark | 13 |
| 9 | TER | 13 |
| 10 | Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024 | 13 |
| 11 | Fussnoten | 14 |
| 12 | Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte | 15 |

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

Regina Kleeb, Mitglied
Unabhängige Verwaltungsrätin, Master of Advanced Studies in Bankmanagement (IFZ)

Geschäftsleitung

Hans Frey
Geschäftsführer
Andreas Hogg
Stellvertretender Geschäftsführer und Leiter Risk, Finance & Services
Silvia Karrer
Leiterin Administration & Operations

Delegationen

Anlageentscheide Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich
Fondsadministration Swisscanto Fondsleitung AG, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

| | von | 01.10.2023 | 01.10.2022 | 01.10.2021 | 01.10.2020 |
|--|------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | bis | 30.09.2024 | 30.09.2023 | 30.09.2022 | 30.09.2021 |
| Konsolidiert | | | | | |
| | CHF | | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 743'750'549.44 | 570'679'832.46 | 427'977'726.23 | 393'114'387.15 |
| Klasse NT CHF | | | | | |
| | CHF | | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 457'134'055.56 | 311'474'326.95 | 199'249'958.01 | 163'744'614.11 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 2'875'266.300 | 2'276'068.297 | 1'581'502.929 | 1'103'109.298 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾ | | 158.9884 | 136.8475 | 125.9877 | 148.4392 |
| Thesaurierung je Anteil | | 2.79 | 2.83 | 2.65 | 2.08 |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 0.04 % | 0.04 % | 0.04 % | 0.04 % |
| Klasse VT CHF | | | | | |
| | CHF | | | | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 286'616'493.88 | 259'205'505.51 | 228'727'768.22 | 229'369'773.04 |
| Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode | | 1'867'016.926 | 1'954'180.172 | 1'865'959.381 | 1'582'154.536 |
| Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾ | | 153.5157 | 132.6416 | 122.5792 | 144.9731 |
| Thesaurierung je Anteil | | 2.15 | 2.24 | 2.04 | 1.51 |
| Total Expense Ratio (Synthetische TER) | | 0.42 % | 0.42 % | 0.42 % | 0.42 % |

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

Performance

| | 2023 / 2024 | 2023 | 2022 | 2021 |
|---------------|-------------|--------|----------|---------|
| Klasse NT CHF | 16.18 % | 7.99 % | -15.19 % | 16.60 % |
| Klasse VT CHF | 15.74 % | 7.58 % | -15.51 % | 16.16 % |

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) | 30.09.2024 | 30.09.2023 |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Bankguthaben auf Sicht | 545'855.80 | 24'311.77 |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 739'243'556.16 | 571'098'574.11 |
| Derivative Finanzinstrumente | -135'692.28 | -601'096.98 |
| Sonstige Vermögenswerte | 4'187'111.08 | 3'691'180.57 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 743'840'830.76 | 574'212'969.47 |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten | 0.00 | -3'452'288.18 |
| Andere Verbindlichkeiten | -90'281.32 | -80'848.83 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 743'750'549.44 | 570'679'832.46 |

Entwicklung der Anzahl Anteile

| Klasse NT CHF | von bis | 01.10.2023 30.09.2024 | 01.10.2022 30.09.2023 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 2'276'068.297 | 1'581'502.929 |
| Ausgegebene Anteile | | 927'611.888 | 830'900.478 |
| Zurückgenommene Anteile | | -328'413.885 | -136'335.110 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 2'875'266.300 | 2'276'068.297 |

| Klasse VT CHF | von bis | 01.10.2023 30.09.2024 | 01.10.2022 30.09.2023 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | | 1'954'180.172 | 1'865'959.381 |
| Ausgegebene Anteile | | 271'944.854 | 359'071.937 |
| Zurückgenommene Anteile | | -359'108.100 | -270'851.146 |
| Bestand am Ende der Rechnungsperiode | | 1'867'016.926 | 1'954'180.172 |

Veränderung des Nettofondsvermögens

| Konsolidiert | von bis | 01.10.2023 30.09.2024 | 01.10.2022 30.09.2023 |
|--|------------|--------------------------|--------------------------|
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode | | 570'679'832.46 | 427'977'726.23 |
| Saldo aus dem Anteilverkehr | | 74'730'366.34 | 105'653'937.57 |
| Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung | | 98'340'350.64 | 37'048'168.66 |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | | 743'750'549.44 | 570'679'832.46 |

Erfolgsrechnung

| Konsolidiert | von bis | 01.10.2023 30.09.2024 | 01.10.2022 30.09.2023 |
|---|------------|--------------------------|--------------------------|
| Ertrag | | | |
| Erträge der Bankguthaben auf Sicht | | 1'161.64 | 2.35 |
| Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht | | -902.24 | -0.44 |
| Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | 12'733'441.89 | 11'231'942.18 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen | | 747'915.06 | 966'116.30 |
| Total Ertrag | | 13'481'616.35 | 12'198'060.39 |
| Aufwand | | | |
| Passivzinsen | | -1'323.85 | -4'610.10 |
| Reglementarische Vergütungen | | -1'029'098.65 | -982'859.52 |
| Sonstige Aufwendungen | | -1'305.85 | -1'515.30 |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen | | -407'355.37 | -367'469.78 |
| Total Aufwand | | -1'439'083.72 | -1'356'454.70 |
| Nettoertrag / Verlust | | 12'042'532.63 | 10'841'605.69 |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | -2'188'494.23 | 2'179'350.34 |
| Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen | | 160'507.58 | 178'987.22 |
| Realisierter Erfolg | | 10'014'545.98 | 13'199'943.25 |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste | | 88'325'804.66 | 23'848'225.41 |
| Gesamterfolg | | 98'340'350.64 | 37'048'168.66 |

Verwendung des Erfolges

| Klasse NT CHF | 30.09.2024 | 30.09.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Nettoertrag | 8'022'515.37 | 6'449'226.23 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 8'022'515.37 | 6'449'226.23 |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 8'022'515.37 | 6'449'226.23 |
| Total | 8'022'515.37 | 6'449'226.23 |

| Klasse VT CHF | 30.09.2024 | 30.09.2023 |
|---|---------------------|---------------------|
| Nettoertrag | 4'020'017.26 | 4'392'379.46 |
| Zur Verteilung verfügbarer Erfolg | 4'020'017.26 | 4'392'379.46 |
| Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage | 4'020'017.26 | 4'392'379.46 |
| Total | 4'020'017.26 | 4'392'379.46 |

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

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|--|--|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|---------------|-----------------------|--------------|------|
| Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden | | | | | | | 739'243'556.16 | 99.38 | |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | | | | | | | 739'243'556.16 | 99.38 | |
| CH0117044658 | SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF | 65'174 | 7'670 | 5'244 | 67'599 CHF | 162.82 | 11'006'746.50 | 1.48 | a) |
| CH0117044831 | SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF | 31'577 | 3'679 | 2'662 | 32'595 CHF | 139.47 | 4'545'953.31 | 0.61 | a) |
| CH0117044864 | SWC (CH) INDEX EF CANADA NT | 32'758 | 3'958 | 1'975 | 34'742 CAD | 224.06 | 4'860'514.41 | 0.65 | a) |
| CH0117045077 | SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT | 189'527 | 40'469 | 5'085 | 224'910 CHF | 114.49 | 25'750'347.09 | 3.46 | a) |
| CH0117045127 | SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT | 111'438 | 25'204 | 2'782 | 133'860 CHF | 109.13 | 14'607'562.64 | 1.96 | a) |
| CH0117045317 | SWC (CH) IBF WORLD EX CHF GOVT. (I) NTH1 CHF | 91'932 | 23'615 | 1'585 | 113'963 CHF | 96.65 | 11'014'091.37 | 1.48 | a) |
| CH0117048352 | SWC (CH) INDEX BF WLD EX JPY/CHF INFL.-L. NTH1 CHF | 108'393 | 27'151 | 1'516 | 134'028 CHF | 108.36 | 14'523'875.04 | 1.95 | a) |
| CH0117052396 | SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR | 31'751 | 4'340 | 36'091 | 0 EUR | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| CH0117052420 | SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD | 67'115 | 8'295 | 75'410 | 0 USD | 0.00 | 0.00 | 0.00 | |
| CH0117052453 | SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF | 6'132 | 1'160 | 144 | 7'148 CHF | 105.67 | 755'300.24 | 0.10 | a) |
| CH0117052545 | SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF | 181'966 | 31'283 | 6'064 | 207'186 CHF | 179.47 | 37'184'404.43 | 5.00 | a) |
| CH0132501872 | SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF | 517'125 | 216'470 | 36'115 | 697'481 CHF | 47.94 | 33'437'937.87 | 4.50 | a) |
| CH0132501898 | SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT | 216'259 | 39'276 | 4'250 | 251'285 CHF | 324.77 | 81'609'936.18 | 10.97 | a) |
| CH0215804714 | SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF | 596'309 | 99'357 | 13'790 | 681'877 CHF | 171.46 | 116'917'758.48 | 15.72 | a) |
| CH0398970274 | SWC (CH) IX BF EMMA HARD CURRENCY NTH1 CHF | 36'980 | 7'240 | 608 | 43'612 CHF | 85.19 | 3'715'212.88 | 0.50 | a) |
| CH0414225430 | SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD | 277 | 33 | 18 | 292 USD | 230'352.34 | 56'757'287.81 | 7.63 | a) |
| CH0465056536 | SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF | 130'839 | 25'369 | 20'648 | 135'560 CHF | 171.22 | 23'210'958.81 | 3.12 | a) |
| CH0512828978 | SWC (CH) IPF I IEF JAPAN ST | 44 | 5 | 4 | 45 JPY | 16'805'133.38 | 4'466'460.22 | 0.60 | a) |
| CH0527915919 | SWC(CH)IPF I INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH ST CHF | 382 | 90 | 43 | 429 CHF | 172'813.20 | 74'105'754.79 | 9.96 | a) |
| CH0527916826 | SWC (CH) IPF III INDEX EF MSCI® WORLD EX CH ST CHF | 323 | 39 | 22 | 340 CHF | 194'029.72 | 66'039'373.00 | 8.88 | a) |
| CH0561458693 | SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF | 522'808 | 124'653 | 27'324 | 620'136 CHF | 98.83 | 61'285'183.51 | 8.24 | a) |
| CH0595708501 | SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NTH1 CHF | 0 | 50'017 | 0 | 50'017 CHF | 89.84 | 4'493'544.24 | 0.60 | a) |
| CH1117196035 | SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF | 61'336 | 13'008 | 956 | 73'388 CHF | 98.95 | 7'261'830.60 | 0.98 | a) |
| CH1223982641 | SWC (CH) IPF I IEF USA RESPONSIBLE ST USD | 414 | 49 | 28 | 435 USD | 154'605.96 | 56'791'106.69 | 7.63 | a) |
| CH1223983292 | SWC (CH) IPF I IEF JAPAN RESPONSIBLE ST | 52 | 6 | 5 | 54 JPY | 14'102'384.41 | 4'460'940.62 | 0.60 | a) |
| CH1224244850 | SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF | 82 | 10 | 7 | 85 CHF | 129'849.19 | 11'023'027.86 | 1.48 | a) |
| CH1325827249 | SWC (CH) IBF CORP. USD RESPONSIBLE NTH1 CHF | 0 | 91'200 | 0 | 91'200 CHF | 103.27 | 9'418'447.57 | 1.27 | a) |
| CH | | | | | | | 739'243'556.16 | 99.38 | |
| Derivative Finanzinstrumente | | | | | | | -135'692.28 | -0.02 | |
| Devisentermingeschäfte | | | | | | | | | |
| | USD/CHF | Verfall 02.11.2023 | 91'257'447 | 100'655'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF | Verfall 02.11.2023 | 13'971'761 | 14'509'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF | Verfall 02.11.2023 | 5'532'023 | 4'981'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF | Verfall 02.11.2023 | 7'825'261 | 1'277'360'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF | Verfall 02.11.2023 | 2'417'597 | 4'110'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF | Verfall 02.11.2023 | 3'875'215 | 5'745'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | NOK/CHF | Verfall 02.11.2023 | 237'379 | 2'780'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| | HKD/CHF | Verfall 02.11.2023 | 717'209 | 6'187'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| | SGD/CHF | Verfall 02.11.2023 | 427'567 | 641'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF | Verfall 02.11.2023 | 1'017'955 | 12'147'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF | Verfall 02.11.2023 | 1'074'218 | 8'312'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF | Verfall 02.11.2023 | 10'593 | 11'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF | Verfall 02.11.2023 | 129'198 | 141'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF | Verfall 02.11.2023 | 7'767 | 7'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF | Verfall 02.11.2023 | 24'082 | 25'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|----------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| | USD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 146'952 | 160'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/JPY Verfall 02.11.2023 | | 5'500'000 | 33'315 | JPY/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/USD Verfall 02.11.2023 | | 90'000 | 81'047 | USD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.11.2023 | | 14'206 | 15'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 35'029 | 39'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.11.2023 | | 6'536 | 6'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 6'501 | 10'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 7'817 | 12'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.11.2023 | | 19'097 | 20'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.11.2023 | | 8'769 | 8'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 119'130 | 132'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 02.11.2023 | | 16'897 | 2'800'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 8'620 | 15'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 311'989 | 346'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.11.2023 | | 13'693 | 21'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 02.11.2023 | | 27'234 | 4'500'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.11.2023 | | 43'091 | 45'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.11.2023 | | 20'826 | 19'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.12.2023 | | 88'260'865 | 98'239'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.12.2023 | | 13'685'497 | 14'310'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.12.2023 | | 5'325'065 | 4'871'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 04.12.2023 | | 7'388'373 | 1'230'360'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.12.2023 | | 2'309'610 | 4'035'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.12.2023 | | 3'660'713 | 5'631'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | SGD/CHF Verfall 04.12.2023 | | 416'269 | 632'000 | CHF/SGD | | 0.00 | 0.00 | |
| | HKD/CHF Verfall 04.12.2023 | | 723'206 | 6'298'000 | CHF/HKD | | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 04.12.2023 | | 1'065'068 | 8'310'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| | NOK/CHF Verfall 04.12.2023 | | 223'779 | 2'775'000 | CHF/NOK | | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 04.12.2023 | | 964'735 | 11'924'000 | CHF/SEK | | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 04.12.2023 | | 19'901 | 3'300'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.12.2023 | | 95'775 | 106'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.12.2023 | | 10'565 | 11'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/JPY Verfall 04.12.2023 | | 6'000'000 | 35'527 | JPY/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/HKD Verfall 04.12.2023 | | 55'000 | 6'276 | HKD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/EUR Verfall 04.12.2023 | | 65'000 | 62'779 | EUR/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/AUD Verfall 04.12.2023 | | 35'000 | 20'203 | AUD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/CAD Verfall 04.12.2023 | | 30'000 | 19'467 | CAD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/USD Verfall 04.12.2023 | | 556'000 | 495'127 | USD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/GBP Verfall 04.12.2023 | | 26'000 | 28'844 | GBP/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/DKK Verfall 04.12.2023 | | 50'000 | 6'476 | DKK/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/USD Verfall 04.12.2023 | | 78'000 | 69'003 | USD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/JPY Verfall 04.12.2023 | | 1'100'000 | 6'466 | JPY/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.12.2023 | | 37'609 | 39'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 94'281'219 | 108'360'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.01.2024 | | 5'492'076 | 4'972'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 14'702'202 | 15'419'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 2'391'976 | 4'145'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 3'871'538 | 6'046'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 04.01.2024 | | 1'001'124 | 11'958'000 | CHF/SEK | | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 04.01.2024 | | 1'114'945 | 8'715'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| | NOK/CHF Verfall 04.01.2024 | | 227'716 | 2'793'000 | CHF/NOK | | 0.00 | 0.00 | |
| | HKD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 714'639 | 6'413'000 | CHF/HKD | | 0.00 | 0.00 | |
| | SGD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 410'209 | 628'000 | CHF/SGD | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 439'892 | 506'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 66'030 | 70'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.01.2024 | | 28'562 | 26'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 04.01.2024 | | 6'581 | 52'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 15'592 | 27'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 22'521 | 35'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 9'655 | 15'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 29'242 | 31'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.01.2024 | | 13'184 | 12'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 244'751 | 281'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 6'345 | 11'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 53'741 | 57'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 246'595 | 283'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.01.2024 | | 18'689 | 17'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/EUR Verfall 04.01.2024 | | 40'000 | 37'754 | EUR/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/USD Verfall 04.01.2024 | | 212'000 | 185'272 | USD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/GBP Verfall 04.01.2024 | | 15'000 | 16'494 | GBP/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 9'441 | 10'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 40'232 | 47'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 22'550 | 35'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 15'124 | 26'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|----------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 321'351 | 376'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 75'113 | 80'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 316'297 | 374'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 7'527 | 13'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 04.01.2024 | | 6'927 | 55'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 12'802 | 20'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 04.01.2024 | | 6'647 | 78'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.01.2024 | | 31'343 | 29'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 10'780 | 17'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.01.2024 | | 57'579 | 62'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.01.2024 | | 17'085 | 16'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 6'311 | 11'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.01.2024 | | 270'935 | 324'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 7'717'971 | 1'297'860'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 29'586 | 5'000'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 23'204 | 3'900'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 51'181 | 8'600'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | CHF/JPY Verfall 05.01.2024 | | 7'900'000 | 48'151 | | JPY/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 24'648 | 4'100'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 27'367 | 4'600'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 05.01.2024 | | 20'776 | 3'500'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 98'813'552 | 117'940'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.02.2024 | | 15'194'722 | 16'365'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.02.2024 | | 5'615'380 | 5'257'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 02.02.2024 | | 7'940'037 | 1'333'960'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | SGD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 429'180 | 674'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| | NOK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 231'442 | 2'813'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 1'112'735 | 13'247'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 2'657'029 | 4'637'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | HKD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 717'662 | 6'686'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 1'145'429 | 9'193'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 4'167'476 | 6'580'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 9'710 | 17'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.02.2024 | | 272'831 | 294'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.02.2024 | | 97'704 | 91'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 22'032 | 177'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 02.02.2024 | | 17'835 | 3'000'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 385'051 | 453'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 15'923 | 25'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 21'219 | 257'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 9'723 | 78'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 912'751 | 1'077'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 02.02.2024 | | 85'881 | 14'600'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 22'199 | 39'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 02.02.2024 | | 9'305 | 112'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 34'282 | 54'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | HKD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 6'189 | 57'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.02.2024 | | 162'644 | 175'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.02.2024 | | 61'355 | 57'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 31'272 | 37'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.02.2024 | | 16'719 | 18'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 24'484 | 29'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.02.2024 | | 12'980 | 14'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.02.2024 | | 5'383 | 5'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 13'984 | 22'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 02.02.2024 | | 17'361 | 16'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 02.02.2024 | | 40'201 | 43'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 8'531 | 15'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 02.02.2024 | | 27'555 | 4'700'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 02.02.2024 | | 292'745 | 343'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 04.03.2024 | | 104'390'796 | 121'440'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 04.03.2024 | | 15'654'722 | 16'806'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 04.03.2024 | | 5'839'203 | 5'352'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| | JPY/CHF Verfall 04.03.2024 | | 8'392'416 | 1'433'660'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| | CAD/CHF Verfall 04.03.2024 | | 4'264'484 | 6'652'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| | AUD/CHF Verfall 04.03.2024 | | 2'636'882 | 4'654'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| | SEK/CHF Verfall 04.03.2024 | | 1'094'339 | 13'228'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| | DKK/CHF Verfall 04.03.2024 | | 1'226'076 | 9'809'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| | NOK/CHF Verfall 04.03.2024 | | 229'531 | 2'795'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| | SGD/CHF Verfall 04.03.2024 | | 427'995 | 666'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| | HKD/CHF Verfall 04.03.2024 | | 703'079 | 6'386'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| | USD/CHF Verfall 03.04.2024 | | 108'279'090 | 123'677'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| | EUR/CHF Verfall 03.04.2024 | | 16'267'146 | 17'112'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| | GBP/CHF Verfall 03.04.2024 | | 5'936'691 | 5'353'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| AUD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 2'691'886 | 4'721'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 8'897'621 | 1'515'660'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 430'903 | 661'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 4'288'558 | 6'650'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 1'332'686 | 10'449'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 220'761 | 2'670'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 1'174'418 | 13'846'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| HKD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 705'733 | 6'304'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 25'901 | 27'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 74'090 | 84'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 38'426 | 44'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 19'159 | 20'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 26'289 | 30'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 13'405 | 14'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 28'915 | 33'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 13'435 | 14'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 51'885 | 54'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 105'826 | 120'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 7'871 | 7'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 11'534 | 12'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 25'583 | 29'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 61'063 | 69'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.04.2024 | | 30'843 | 32'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/JPY | Verfall 03.04.2024 | | 2'300'000 | 13'524 | | JPY/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/EUR | Verfall 03.04.2024 | | 30'000 | 28'998 | | EUR/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/GBP | Verfall 03.04.2024 | | 11'000 | 12'446 | | GBP/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/AUD | Verfall 03.04.2024 | | 31'000 | 18'021 | | AUD/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/USD | Verfall 03.04.2024 | | 61'000 | 54'297 | | USD/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 9'290'780 | 1'549'760'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 13'029'872 | 13'354'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 6'227'939 | 5'469'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 4'479'877 | 6'746'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 2'757'280 | 4'698'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 450'943 | 673'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 1'416'908 | 10'827'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| HKD/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 674'733 | 5'838'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 104'531'580 | 115'752'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 1'212'543 | 14'343'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 228'527 | 2'740'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/JPY | Verfall 03.05.2024 | | 4'500'000 | 26'778 | | JPY/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.05.2024 | | 197'244 | 216'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 12'956'793 | 13'290'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 6'401'785 | 5'616'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 103'533'628 | 113'823'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 8'732'253 | 1'498'860'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 233'614 | 2'830'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 4'504'544 | 6'779'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 458'810 | 686'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| HKD/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 687'169 | 5'906'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 2'712'908 | 4'567'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 1'170'558 | 14'078'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 04.06.2024 | | 1'404'000 | 10'736'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/USD | Verfall 04.06.2024 | | 170'000 | 155'171 | | USD/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/SEK | Verfall 04.06.2024 | | 104'000 | 8'914 | | SEK/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/DKK | Verfall 04.06.2024 | | 80'000 | 10'587 | | DKK/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/EUR | Verfall 04.06.2024 | | 97'000 | 95'760 | | EUR/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/JPY | Verfall 04.06.2024 | | 1'500'000 | 8'698 | | JPY/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/GBP | Verfall 04.06.2024 | | 37'000 | 42'940 | | GBP/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/EUR | Verfall 04.06.2024 | | 7'000 | 6'858 | | EUR/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/USD | Verfall 04.06.2024 | | 50'000 | 45'185 | | USD/CHF | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 105'953'806 | 117'455'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 6'311'545 | 5'507'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 8'755'668 | 1'518'360'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 13'017'801 | 13'324'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 2'779'513 | 4'644'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 229'714 | 2'680'000 | | CHF/NOK | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 1'238'835 | 14'526'000 | | CHF/SEK | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 1'443'984 | 11'020'000 | | CHF/DKK | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 436'170 | 653'000 | | CHF/SGD | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 35'101 | 6'100'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 49'311 | 51'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 22'692 | 20'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 10'629 | 18'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 489'092 | 551'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. |
|----------------------------|--------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|------------|------|
| USD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 7'136 | 8'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 6'574 | 77'000 | CHF/SEK | | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 19'539 | 33'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 733'038 | 817'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 52'619 | 9'200'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 68'369 | 71'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 7'618 | 59'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 02.07.2024 | | 29'657 | 26'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| HKD/CHF | Verfall 03.07.2024 | | 708'122 | 6'133'000 | CHF/HKD | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.07.2024 | | 4'455'641 | 6'750'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.07.2024 | | 21'417 | 33'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.07.2024 | | 26'717 | 41'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 6'290'753 | 5'556'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 8'756'929 | 1'566'560'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 110'535'432 | 123'503'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 12'601'915 | 13'133'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| HKD/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 651'858 | 5'679'000 | CHF/HKD | | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 432'819 | 655'000 | CHF/SGD | | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 1'519'082 | 11'803'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 223'358 | 2'660'000 | CHF/NOK | | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 1'216'055 | 14'438'000 | CHF/SEK | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 11'387 | 10'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 11'589 | 10'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| CHF/USD | Verfall 05.08.2024 | | 81'000 | 71'653 | USD/CHF | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 35'409 | 37'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 05.08.2024 | | 15'906 | 14'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 06.08.2024 | | 2'806'350 | 4'723'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 06.08.2024 | | 4'414'226 | 6'757'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 06.08.2024 | | 19'112 | 33'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 108'714'924 | 123'775'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 12'467'627 | 13'102'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 6'425'737 | 5'697'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 4'535'292 | 7'137'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 2'823'628 | 4'937'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 8'991'214 | 1'545'060'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 221'235 | 2'747'000 | CHF/NOK | | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 1'207'721 | 14'758'000 | CHF/SEK | | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 1'401'414 | 10'979'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| HKD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 646'684 | 5'746'000 | CHF/HKD | | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 454'336 | 692'000 | CHF/SGD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 298'839 | 349'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 29'967 | 32'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 13'163 | 12'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 12'369 | 20'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 7'821 | 14'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 29'315 | 5'000'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 37'188 | 6'300'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 8'803 | 14'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 32'067 | 34'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 14'316 | 13'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 164'762 | 191'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 6'479 | 1'100'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 60'440 | 70'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 10'005 | 1'700'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 124'921 | 145'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 13'321 | 14'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 28'720 | 4'900'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 28'457 | 30'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 13'357 | 12'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 13'788 | 22'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 362'128 | 425'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 92'213 | 109'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 03.09.2024 | | 74'113 | 88'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| USD/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 109'493'695 | 129'762'000 | CHF/USD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 12'798'975 | 13'659'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |
| GBP/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 6'438'901 | 5'781'000 | CHF/GBP | | 0.00 | 0.00 | |
| CAD/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 4'662'806 | 7'437'000 | CHF/CAD | | 0.00 | 0.00 | |
| AUD/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 2'930'944 | 5'096'000 | CHF/AUD | | 0.00 | 0.00 | |
| SEK/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 1'270'114 | 15'354'000 | CHF/SEK | | 0.00 | 0.00 | |
| NOK/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 226'506 | 2'815'000 | CHF/NOK | | 0.00 | 0.00 | |
| DKK/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 1'432'648 | 11'395'000 | CHF/DKK | | 0.00 | 0.00 | |
| JPY/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 9'020'434 | 1'542'060'000 | CHF/JPY | | 0.00 | 0.00 | |
| SGD/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 446'043 | 686'000 | CHF/SGD | | 0.00 | 0.00 | |
| EUR/CHF | Verfall 02.10.2024 | | 41'214 | 44'000 | CHF/EUR | | 0.00 | 0.00 | |

| ISIN / Fälligkeitsdatum | Bezeichnung | Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023 | Kauf Zugang 2) | Verkauf Abgang 3) | Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024 | Kurs 8) | Kurswert CHF | in % 7) | Kat. | |
|-------------------------------|----------------------------|------------------------------------|----------------------|-------------------------|---|------------|-----------------|--------------------|--------------|--|
| | JPY/CHF Verfall 02.10.2024 | | 26'869 | 4'600'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | | |
| | AUD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 9'109 | 16'000 | | CHF/AUD | 0.00 | 0.00 | | |
| | GBP/CHF Verfall 02.10.2024 | | 18'861 | 17'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | | |
| | USD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 368'523 | 435'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | | |
| | CAD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 16'893 | 27'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | | |
| | USD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 28'766 | 34'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | | |
| | USD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 52'912 | 63'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | | |
| | EUR/CHF Verfall 02.10.2024 | | 15'887 | 17'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | | |
| | GBP/CHF Verfall 02.10.2024 | | 6'635 | 6'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | | |
| | JPY/CHF Verfall 02.10.2024 | | 13'664 | 2'300'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | | |
| | USD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 185'150 | 219'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | | |
| | CAD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 8'732 | 14'000 | | CHF/CAD | 0.00 | 0.00 | | |
| | EUR/CHF Verfall 02.10.2024 | | 15'858 | 17'000 | | CHF/EUR | 0.00 | 0.00 | | |
| | USD/CHF Verfall 02.10.2024 | | 89'730 | 106'000 | | CHF/USD | 0.00 | 0.00 | | |
| | JPY/CHF Verfall 02.10.2024 | | 9'003 | 1'500'000 | | CHF/JPY | 0.00 | 0.00 | | |
| | GBP/CHF Verfall 02.10.2024 | | 6'611 | 6'000 | | CHF/GBP | 0.00 | 0.00 | | |
| | HKD/CHF Verfall 03.10.2024 | | 657'385 | 6'066'000 | | CHF/HKD | 0.00 | 0.00 | | |
| | GBP/CHF Verfall 04.11.2024 | | 6'516'597 | 5'799'000 | | CHF/GBP | -19'285.46 | 0.00 | b) | |
| | EUR/CHF Verfall 04.11.2024 | | 13'312'272 | 14'187'000 | | CHF/EUR | -11'761.36 | 0.00 | b) | |
| | USD/CHF Verfall 04.11.2024 | | 113'580'736 | 135'326'000 | | CHF/USD | -137'164.59 | -0.02 | b) | |
| | DKK/CHF Verfall 04.11.2024 | | 1'387'424 | 11'019'000 | | CHF/DKK | -1'274.61 | 0.00 | b) | |
| | NOK/CHF Verfall 04.11.2024 | | 221'149 | 2'768'000 | | CHF/NOK | 233.47 | 0.00 | b) | |
| | SEK/CHF Verfall 04.11.2024 | | 1'343'612 | 16'142'000 | | CHF/SEK | 3'266.93 | 0.00 | b) | |
| | AUD/CHF Verfall 04.11.2024 | | 3'044'765 | 5'230'000 | | CHF/AUD | -5'741.58 | 0.00 | b) | |
| | CAD/CHF Verfall 04.11.2024 | | 4'868'825 | 7'832'000 | | CHF/CAD | -6'875.09 | 0.00 | b) | |
| | HKD/CHF Verfall 04.11.2024 | | 730'614 | 6'760'000 | | CHF/HKD | -1'034.14 | 0.00 | b) | |
| | SGD/CHF Verfall 04.11.2024 | | 485'748 | 740'000 | | CHF/SGD | -83.72 | 0.00 | b) | |
| | JPY/CHF Verfall 05.11.2024 | | 9'335'383 | 1'574'160'000 | | CHF/JPY | 44'027.87 | 0.01 | b) | |
| Devisentermingeschäfte | | | | | | | | -135'692.28 | -0.02 | |

| Vermögensaufstellung | Kurswert CHF | in % 7) |
|---|-----------------------|---------------|
| Bankguthaben auf Sicht | 545'855.80 | 0.07 |
| Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen | 739'243'556.16 | 99.38 |
| Derivative Finanzinstrumente | -135'692.28 | -0.02 |
| Sonstige Vermögenswerte | 4'187'111.08 | 0.56 |
| Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 743'840'830.76 | 100.00 |
| Andere Verbindlichkeiten | -90'281.32 | |
| Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode | 743'750'549.44 | |

| 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); | 739'243'556.16 | 99.38 |
| b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern; | -135'692.28 | -0.02 |
| c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden. | 0.00 | 0.00 |

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

| | | |
|-----|-----------|-------------|
| AUD | 1 = CHF | 0.58521281 |
| CAD | 1 = CHF | 0.62441245 |
| DKK | 100 = CHF | 12.62893900 |
| EUR | 1 = CHF | 0.94144104 |
| GBP | 1 = CHF | 1.13149579 |
| HKD | 100 = CHF | 10.85999400 |
| JPY | 100 = CHF | 0.58973000 |
| NOK | 100 = CHF | 8.00890600 |
| SEK | 100 = CHF | 8.32182400 |
| SGD | 1 = CHF | 0.65799532 |
| USD | 1 = CHF | 0.84355000 |

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

| Engagement | Währung | Betrag | in % 28) |
|--|---------|----------------|-------------|
| Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent) | CHF | - | - |
| Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent) | CHF | 155'484'000.77 | 20.905 |

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

| Klasse | Währung | Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30) | | Durchschnitt Ausgabe- spesen in % | Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30) | | Durchschnitt Rücknahme- spesen in % |
|--------|---------|---|--------------|--|---|--------------|--|
| | | Teilvermögen | Fondsleitung | | Teilvermögen | Fondsleitung | |
| NT CHF | CHF | 0.00 - 0.14 | - | 0.066 | 0.00 - 0.08 | - | 0.007 |
| VT CHF | CHF | 0.00 - 0.14 | - | 0.066 | 0.00 - 0.08 | - | 0.007 |

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 18 Ziff. 4 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

| Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten | Währung | Betrag |
|---|---------|--------|
| Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte | CHF | - |
| Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | CHF | - |
| Andere Wertpapiere | CHF | - |

| Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten | Währung | Betrag |
|--|---------|--------|
| Keine | CHF | - |

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

| Klasse | PVK p.a. in % | | PMF p.a. in % | PAF p.a. in % | VK Zielfonds p.a. in % |
|--------|---------------|-------|---------------|---------------|------------------------|
| | Eff | Max | Eff | Eff | Eff |
| NT CHF | - | - | - | - | 4.000 |
| VT CHF | 0.380 | 1.200 | 0.330 | 0.050 | 4.000 |

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

8 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

9 TER

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

10 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 15.01.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 18.01.2025

| Klasse | Affidavit-fähig | Währung | Brutto je Anteil | Abzgl. 35% Eidg. Vst | Netto je Anteil |
|------------|-----------------|---------|------------------|----------------------|-----------------|
| NT CHF 34) | Nein | CHF | 2.790 | - | 2.790 |
| VT CHF 34) | Nein | CHF | 2.153 | - | 2.153 |

11 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. 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.
5. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Ziff. 8 der Tabelle im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
6. 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.