

SWISSCANTO (CH) IPF III VORSORGE FONDS 95 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	51215778	CHF
VT CHF	51196142	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	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	14
11	Fussnoten	15
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

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		754'588'761.94	510'000'773.81	344'198'099.48	282'392'649.49
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		660'459'690.65	435'725'093.38	287'172'887.07	229'370'619.40
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'721'335.662	2'937'553.481	2'164'385.814	1'427'573.520
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		177.4792	148.3292	132.6810	160.6717
Thesaurierung je Anteil		3.34	2.88	2.88	2.33
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.02 %	0.02 %	0.02 %	0.02 %
Klasse VT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		94'129'071.29	74'275'680.43	57'025'212.41	53'022'030.09
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		676'969.147	636'733.399	544'440.119	416'446.415
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		139.0448	116.6511	104.7410	127.3202
Thesaurierung je Anteil		2.13	1.82	1.81	1.39
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %

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	19.65 %	10.94 %	-17.44 %	19.68 %
Klasse VT CHF	19.20 %	10.52 %	-17.75 %	19.23 %

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	471'681.60	27'772.66
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	749'892'304.13	513'114'530.49
Derivative Finanzinstrumente	-241'116.20	-873'476.64
Sonstige Vermögenswerte	4'495'435.04	3'196'157.47
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	754'618'304.57	515'464'983.98
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-5'441'438.20
Andere Verbindlichkeiten	-29'542.63	-22'771.97
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	754'588'761.94	510'000'773.81

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse NT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'937'553.481	2'164'385.814
Ausgegebene Anteile		1'147'290.887	983'691.678
Zurückgenommene Anteile		-363'508.706	-210'524.011
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		3'721'335.662	2'937'553.481
Klasse VT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		636'733.399	544'440.119
Ausgegebene Anteile		165'689.303	148'407.127
Zurückgenommene Anteile		-125'453.555	-56'113.847
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		676'969.147	636'733.399

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		510'000'773.81	344'198'099.48
Saldo aus dem Anteilverkehr		129'972'381.52	122'918'178.85
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		114'615'606.61	42'884'495.48
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		754'588'761.94	510'000'773.81

Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		464.87	130.46
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-90.36	-0.48
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		13'657'921.16	9'474'690.18
Sonstige Erträge		7.89	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		971'021.50	612'037.64
Total Ertrag		14'629'325.06	10'086'857.80
Aufwand			
Passivzinsen		-4'006.12	-5'472.31
Reglementarische Vergütungen		-325'829.00	-264'358.68
Sonstige Aufwendungen		-1'252.22	-2'464.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-409'278.69	-187'004.51
Total Aufwand		-740'366.03	-459'300.40
Nettoertrag / Verlust			
		13'888'959.03	9'627'557.40
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-464'297.26	157'175.21
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		138'844.40	124'856.58
Realisierter Erfolg		13'563'506.17	9'909'589.19
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		101'052'100.44	32'974'906.29
Gesamterfolg		114'615'606.61	42'884'495.48

Verwendung des Erfolges

	30.09.2024	30.09.2023
Klasse NT CHF		
Nettoertrag	12'443'287.28	8'463'041.86
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	12'443'287.28	8'463'041.86
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	12'443'287.28	8'463'041.86
Total	12'443'287.28	8'463'041.86
Klasse VT CHF		
Nettoertrag	1'445'671.75	1'164'515.54
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'445'671.75	1'164'515.54
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'445'671.75	1'164'515.54
Total	1'445'671.75	1'164'515.54

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							749'892'304.13	99.37	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							749'892'304.13	99.37	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	130'770	429	9'070	122'128 CHF	162.82	19'885'449.42	2.64	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	43'932	5'415	1'456	47'892 CHF	139.47	6'679'490.22	0.89	a)
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	45'233	7'732	1'557	51'409 CAD	224.06	7'192'231.09	0.95	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	81'651	23'208	0	104'859 CHF	179.47	18'819'432.32	2.49	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	229'662	73'603	3'658	299'607 CHF	324.77	97'303'456.89	12.89	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	401'998	127'004	12'626	516'376 CHF	171.46	88'540'260.87	11.73	a)
CH0414225430	SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD	550	2	44	508 USD	230'352.34	98'685'718.65	13.08	a)
CH0451461963	SWC (CH) IX EF SWITZERLAND TOTAL RESP. NT CHF	186'937	60'920	6'223	241'634 CHF	152.99	36'968'422.05	4.90	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	95'728	24'930	3'492	117'166 CHF	171.22	20'061'604.99	2.66	a)
CH0512828978	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN ST	87	0	3	85 JPY	16'805'133.38	8'377'833.83	1.11	a)
CH0527915919	SWC(CH)IPF I INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH ST CHF	343	119	28	434 CHF	172'813.20	74'941'997.85	9.93	a)
CH0527916826	SWC (CH) IPF III INDEX EF MSCI® WORLD EX CH ST CHF	161	34	4	191 CHF	194'029.72	36'974'109.18	4.90	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	588'009	233'944	34'525	787'428 CHF	98.83	77'817'871.36	10.31	a)
CH1223982641	SWC (CH) IPF I IEF USA RESPONSIBLE ST USD	330	288	0	619 USD	154'605.96	80'666'181.59	10.69	a)
CH1223983292	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	41	30	0	71 JPY	14'102'384.41	5'873'182.33	0.78	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	64	53	0	117 CHF	129'849.19	15'204'431.58	2.01	a)
CH1253521194	SWC (CH) IPF III INDEX EF MSCI® WORLD EX CH NA CHF	350'244	82'863	14'232	418'875 CHF	133.45	55'900'629.91	7.41	a)
CH							749'892'304.13	99.37	
Derivative Finanzinstrumente							-241'116.20	-0.03	
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		134'062'452	147'868'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		16'845'269	17'493'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		8'006'496	7'209'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		12'401'852	2'024'422'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		3'846'390	6'539'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		6'131'541	9'090'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		378'013	4'427'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		1'141'252	9'845'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		680'372	1'020'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		1'621'085	19'344'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		1'710'581	13'236'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		609'338	665'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'349	5'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		32'176	29'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		6'976	54'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		6'463	78'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		7'426	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		344'418	375'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		68'392	71'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		147'742	156'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		15'356	121'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		13'824	172'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		69'716	64'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		366'415	406'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		5'869	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		12'104	2'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		17'237	18'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		4'022	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		7'673	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		514'872	571'000		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 04.12.2023		130'956'954	145'762'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		16'528'753	17'283'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		7'761'848	7'100'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		11'667'812	1'943'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		3'646'722	6'371'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'794'341	8'913'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		656'018	996'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		1'142'224	9'947'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		1'711'286	13'352'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		359'498	4'458'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		1'550'259	19'161'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		107'065	118'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		6'501	80'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		31'902	29'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		69'155	72'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		3'277	5'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		10'745	93'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		87'643	97'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		7'208	56'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		5'965	9'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		34'263	59'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		7'237	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		2'781'751	3'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		336'817	350'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		252'170	280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		27'736	25'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		59'874	62'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		148'600	25'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		178'084	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		6'475	50'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		577'090	600'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		1'769'122	2'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		43'395	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		99'619	113'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		19'896	18'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		92'884	160'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		149'028	230'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		3'207'746	3'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		39'661	470'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		433'951	450'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		211'198	190'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		275'527	46'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		34'907	5'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		198'993	226'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		58'757	91'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		75'212	78'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		30'398	270'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		33'405	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		17'140	26'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		7'630	59'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		377'513	430'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		101'468	174'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		5'170	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		7'192	85'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		111'086	18'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		309'621	354'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		143'539'588	164'974'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		8'181'780	7'407'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		18'377'037	19'273'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		3'904'489	6'766'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		6'407'952	10'007'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		1'652'214	19'735'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		1'840'075	14'383'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		375'858	4'610'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		1'166'512	10'468'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		669'529	1'025'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		398'163	458'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		26'368	24'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		5'948	47'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		59'428	63'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		309'205	355'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		5'420	65'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		7'336	58'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		2'862	5'000		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.
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		73'540	78'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		4'500	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		31'880	29'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		508'003	583'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		6'664	80'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		156'765	180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		329'547	377'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		342'154	390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		28'626	26'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		66'037	70'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		6'581	52'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		5'933	71'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		91'795	105'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		15'110	16'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		6'570	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		119'743	137'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		5'153	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		309'440	358'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		25'198	23'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		421'937	487'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		5'521	65'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		59'620	63'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		5'714	45'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		38'917	67'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		523'599	610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		9'010	14'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		11'265	89'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		6'464	10'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		10'826	128'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		117'962	125'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		2'258	27'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		10'783	98'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		51'400	47'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		113'847	133'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		21'309	33'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		316'223	370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		36'187	331'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		133'786	230'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		800'892	947'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		180'165	194'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		3'546	43'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		109'072	172'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		6'884	12'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		17'145	204'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		17'941	144'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		77'951	73'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		530'163	634'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		12'594'495	2'117'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		8'927	1'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		70'957	11'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		10'272	1'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		17'952	3'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		218'440	36'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		153'332'761	183'012'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		19'313'500	20'801'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		8'475'945	7'935'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		13'175'856	2'213'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		720'181	1'131'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		387'438	4'709'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		1'862'846	22'177'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		4'459'706	7'783'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		1'204'654	11'223'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		1'917'563	15'390'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		7'019'473	11'083'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		1'125'404	1'324'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		59'040	93'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		8'297	13'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		31'038	249'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		29'661	357'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		1'611'086	1'901'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		14'551	134'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		137'779	128'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		310'419	334'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		51'798	91'000		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.
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		174'114	29'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		6'172	75'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		123'531	133'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		12'458	100'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		52'380	8'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		608'535	720'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		11'945	144'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		2'477	30'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		54'975	51'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		278'609	330'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		51'865	61'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		276'101	325'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		6'883	1'176'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		68'071	73'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		7'523	60'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		71'988	77'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		31'467	29'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		69'922	110'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		275'675	323'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		6'720	81'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		164'032'118	190'822'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		20'288'914	21'781'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		9'003'196	8'252'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		14'173'177	2'421'176'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		7'318'604	11'416'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		4'494'144	7'932'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		1'869'179	22'594'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		2'094'291	16'755'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		392'050	4'774'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		729'391	1'135'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.03.2024		1'198'406	10'885'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		199'530	227'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		187'414	213'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		104'875	119'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		207'785	236'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		172'001'409	196'461'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		21'319'734	22'427'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		9'189'505	8'286'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		4'621'422	8'105'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		15'097'508	2'571'776'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		739'902	1'135'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		7'436'296	11'531'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		2'284'915	17'915'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.04.2024		378'436	4'577'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		2'013'712	23'741'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.04.2024		1'211'747	10'824'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		27'343	31'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		78'037	89'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		211'342	242'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		162'101	185'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		696'668	795'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		225'188	257'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2024		15'953'097	2'661'076'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		22'567'613	23'129'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		9'709'162	8'526'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		7'786'326	11'725'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		4'779'167	8'143'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		781'947	1'167'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		2'454'037	18'752'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2024		1'169'398	10'118'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		180'967'905	200'393'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		2'100'118	24'842'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2024		395'752	4'745'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		524'146	581'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		635'433	705'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		31'957	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		432'842	474'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		12'692	19'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		7'757	13'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		36'128	37'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		3'928	30'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		3'257	39'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2024		23'843	4'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		15'948	14'000	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.
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		493'624	540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		454'361	499'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		12'949	99'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		10'831	130'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		52'560	46'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		119'008	122'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		22'603'706	23'185'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		10'099'682	8'860'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		181'522'904	199'563'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		15'063'967	2'585'676'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		407'544	4'937'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		7'834'943	11'791'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		796'563	1'191'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.06.2024		1'192'947	10'253'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		4'710'016	7'929'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		2'042'115	24'560'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		2'449'416	18'730'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		121'750	135'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		412'325	457'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		94'197	104'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		12'457	11'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		28'282	29'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		49'435	8'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		291'154	322'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		306'100	339'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		3'138	37'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		309'738	342'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		80'507	70'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		16'420	194'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		99'874	150'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		179'374	182'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		19'153	145'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		33'591	37'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		9'298	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		14'611	2'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		22'768	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		182'652	200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		7'349	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		86'703	95'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		114'269	19'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		187'998'884	208'406'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		10'118'873	8'829'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		4'890'482	8'171'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		407'999	4'760'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		2'200'583	25'803'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		2'564'971	19'575'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		767'472	1'149'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		15'463'388	2'681'576'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		23'124'086	23'668'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		103'696	116'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		284'934	321'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		326'545	367'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		311'339	347'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		147'877	166'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		13'193	156'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		90'582	101'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		61'261	54'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		16'360	127'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		135'470	141'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.07.2024		1'245'709	10'789'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		7'858'431	11'905'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		10'071'319	8'895'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		15'319'573	2'740'576'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		195'200'831	218'101'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		22'350'095	23'292'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.08.2024		1'137'050	9'906'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.08.2024		756'607	1'145'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.08.2024		2'694'140	20'933'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.08.2024		396'082	4'717'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		2'156'775	25'607'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		81'038	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		135'534	140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		367'139	408'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.08.2024		16'230	125'000		CHF/DKK	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.
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		60'467	53'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		11'200	2'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		13'084	154'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		456'849	511'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		190'592	216'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		988'581	1'116'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		549'068	620'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		4'895'515	8'239'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		7'707'421	11'798'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		3'600	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		5'917	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		195'400'529	222'469'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		22'014'850	23'135'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		10'203'128	9'046'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		7'854'310	12'360'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		4'874'005	8'522'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		15'638'728	2'687'376'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		390'685	4'851'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		2'132'620	26'060'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		2'474'526	19'386'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		1'116'334	9'919'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.09.2024		783'927	1'194'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		541'163	632'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		8'343	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		4'319	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		3'670	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		11'162	12'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		245'371	290'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		113'003	131'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		849'639	985'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		910'936	1'056'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		14'973	2'549'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		190'548	220'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		88'619	80'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		187'636	198'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		5'709	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		24'617	194'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		20'154	245'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		208'289	220'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		17'670	3'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		9'442	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		96'347	87'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		322'057	373'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		33'173	401'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		6'221	77'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		40'430	317'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		343'500	361'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		158'403	143'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		56'513	65'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		194'577	230'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		117'474	20'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		391'622	465'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		199'305'661	236'199'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		23'480'248	25'058'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		10'639'056	9'552'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		7'945'642	12'673'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		5'005'496	8'703'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		2'330'196	28'169'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		415'516	5'164'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		2'628'302	20'905'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		16'321'115	2'790'125'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		761'394	1'171'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		35'504	32'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		156'728	185'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		5'693	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		83'215	133'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		78'682	84'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		7'645	93'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		8'792	70'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		116'823	20'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		92'385	110'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		36'832	6'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		44'808	53'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		5'530	5'000	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 02.10.2024		13'505	24'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		14'018	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		36'798	59'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		3'257	40'000		CHF/SEK	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		14'356	13'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		4'354	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		3'751	30'000		CHF/DKK	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		446'540	528'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		7'727	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		33'576	36'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		520'604	615'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	HKD/CHF Verfall 03.10.2024		1'122'626	10'359'000		CHF/HKD	0.00	0.00		
	HKD/CHF Verfall 03.10.2024		3'147	29'000		CHF/HKD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		10'701'424	9'523'000		CHF/GBP	-31'670.20	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		24'255'228	25'849'000		CHF/EUR	-21'429.45	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 04.11.2024		205'353'628	244'669'000		CHF/USD	-247'993.16	-0.03	b)	
	DKK/CHF Verfall 04.11.2024		2'528'061	20'078'000		CHF/DKK	-2'322.50	0.00	b)	
	NOK/CHF Verfall 04.11.2024		402'990	5'044'000		CHF/NOK	425.44	0.00	b)	
	SEK/CHF Verfall 04.11.2024		2'448'167	29'412'000		CHF/SEK	5'952.61	0.00	b)	
	AUD/CHF Verfall 04.11.2024		5'182'504	8'902'000		CHF/AUD	-9'772.77	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 04.11.2024		8'320'892	13'385'000		CHF/CAD	-11'749.63	0.00	b)	
	HKD/CHF Verfall 04.11.2024		1'243'557	11'506'000		CHF/HKD	-1'760.18	0.00	b)	
	SGD/CHF Verfall 04.11.2024		827'741	1'261'000		CHF/SGD	-142.66	0.00	b)	
	JPY/CHF Verfall 05.11.2024		16'824'072	2'836'925'000		CHF/JPY	79'346.30	0.01	b)	
Devisentermingeschäfte								-241'116.20	-0.03	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	471'681.60	0.06
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	749'892'304.13	99.37
Derivative Finanzinstrumente	-241'116.20	-0.03
Sonstige Vermögenswerte	4'495'435.04	0.60
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	754'618'304.57	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-29'542.63	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	754'588'761.94	

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);	749'892'304.13	99.37
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-241'116.20	-0.03
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

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	279'265'107.14	37.009

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 - 0.10	-	0.060	0.00 - 0.06	-	0.002
VT CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.060	0.00 - 0.06	-	0.002

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	3.343	-	3.343
VT CHF 34)	Nein	CHF	2.135	-	2.135

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.