

# ZKB GOLD ETF

Jahresbericht per 30.09.2024

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
AA CHF	13910159	CHF
AA EUR	4753352	EUR
AA GBP	10449329	GBP
AA USD	4753354	USD
AAH CHF	13910160	CHF
AAH EUR	10332676	EUR
AAH GBP	10449330	GBP

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter [www.swisscanto-fondsleitungen.com](http://www.swisscanto-fondsleitungen.com) zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich, 27.01.2025

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Januar 2025

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds ZKB Gold ETF, bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die beigelegte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



#### 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 Jahresrechnung“ 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 Jahresrechnung

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



### **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, 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 Jahresrechnung 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 der Jahresrechnung 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**

- ▶ Jahresrechnung bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, der Erfolgsrechnung 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	20
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
7	Pauschale Verwaltungskommission	21
8	Benchmark	21
9	TER	21
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	22
11	Fussnoten	22
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23
13	Pflichtpublikationen	24

# 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
<b>Konsolidiert</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		11'470'968'977.69	8'231'343'803.29	8'238'927'850.54	8'829'096'134.38
<b>Klasse AA CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		4'692'028'238.60	3'795'538'149.38	3'683'491'619.12	3'920'472'612.55
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'095'932.000	7'411'932.000	7'450'280.000	7'988'346.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		661.23	512.08	494.41	490.77
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
<b>Klasse AA EUR</b>					
<b>EUR</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		1'262'089'143.99	1'045'697'274.77	1'114'394'362.99	1'170'246'846.70
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		606'966.000	649'366.000	716'766.000	758'266.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		2'208.68	1'662.63	1'612.44	1'427.51
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
<b>Klasse AA GBP</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		29'205'275.02	18'740'537.30	18'873'592.82	21'986'293.43
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'000.000	11'600.000	12'100.000	14'200.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		1'843.66	1'446.91	1'419.66	1'230.97
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
<b>Klasse AA USD</b>					
<b>USD</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		2'799'361'859.23	1'869'950'128.29	1'915'018'653.74	2'025'946'316.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'346'258.017	1'161'204.000	1'231'704.000	1'312'704.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		2'465.02	1'760.34	1'579.65	1'654.43
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
<b>Klasse AAH CHF</b>					
<b>CHF</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'937'062'290.10	1'157'096'002.25	1'164'391'854.05	1'285'593'608.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		3'335'798.000	2'666'954.000	2'854'254.000	2'953'254.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		580.69	433.86	407.95	435.31
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
<b>Klasse AAH EUR</b>					
<b>EUR</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		644'153'798.50	329'523'324.45	327'539'472.46	386'924'269.93
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		505'217.150	344'812.000	372'712.000	369'712.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		1'354.31	986.70	911.41	968.02
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
<b>Klasse AAH GBP</b>					
<b>GBP</b>					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		107'068'372.25	14'798'386.85	15'218'295.36	17'926'186.85
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		68'065.007	13'250.000	15'200.000	14'900.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		1'390.22	1'000.27	911.25	956.50
Total Expense Ratio (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 AA CHF	29.13 %	3.81 %	1.53 %	-1.82 %
Klasse AA EUR	32.84 %	10.25 %	6.54 %	2.49 %
Klasse AA GBP	27.42 %	7.67 %	12.58 %	-3.87 %
Klasse AA USD	40.03 %	14.11 %	-0.02 %	-4.75 %
Klasse AAH CHF	33.84 %	9.11 %	-2.82 %	-6.03 %
Klasse AAH EUR	37.26 %	11.37 %	-2.18 %	-5.64 %
Klasse AAH GBP	38.98 %	12.76 %	-0.87 %	-4.91 %

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	756'146.44	842'522.48
Andere Anlagen - Edelmetalle	11'473'400'148.18	8'238'373'331.29
Derivative Finanzinstrumente	611'675.76	423'041.13
Sonstige Vermögenswerte	14'334.89	567.16
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>11'474'782'305.27</b>	<b>8'239'639'462.06</b>
Andere Verbindlichkeiten	-3'813'327.58	-8'295'658.77
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>11'470'968'977.69</b>	<b>8'231'343'803.29</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AA CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'411'932.000	7'450'280.000
Ausgegebene Anteile		127'000.000	263'000.000
Zurückgenommene Anteile		-443'000.000	-300'000.000
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-	-1'348.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>7'095'932.000</b>	<b>7'411'932.000</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AA EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		649'366.000	716'766.000
Ausgegebene Anteile		2'100.000	5'000.000
Zurückgenommene Anteile		-44'500.000	-72'400.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>606'966.000</b>	<b>649'366.000</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AA GBP</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'600.000	12'100.000
Ausgegebene Anteile		3'600.000	1'000.000
Zurückgenommene Anteile		-1'200.000	-1'500.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>14'000.000</b>	<b>11'600.000</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AA USD</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'161'204.000	1'231'704.000
Ausgegebene Anteile		14'000.712	10'000.000
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		291'621.668	-
Zurückgenommene Anteile		-120'568.363	-80'500.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'346'258.017</b>	<b>1'161'204.000</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AAH CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'666'954.000	2'854'254.000
Ausgegebene Anteile		17'500.824	50'000.000
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		961'382.126	-
Zurückgenommene Anteile		-310'038.950	-237'300.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>3'335'798.000</b>	<b>2'666'954.000</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AAH EUR</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		344'812.000	372'712.000
Ausgegebene Anteile		2.650	25'400.000
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		263'374.403	-
Zurückgenommene Anteile		-102'971.903	-53'300.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>505'217.150</b>	<b>344'812.000</b>

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Klasse AAH GBP</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		13'250.000	15'200.000
Ausgegebene Anteile		0.004	1'800.000
Ausgegebene Anteile aus übernommenen Fonds		60'753.149	-
Zurückgenommene Anteile		-5'938.146	-3'750.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>68'065.007</b>	<b>13'250.000</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		8'231'343'803.29	8'238'927'850.54
Saldo aus dem Anteilverkehr		539'516'737.16	-367'508'651.52
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		2'700'108'437.24	359'924'604.27
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>11'470'968'977.69</b>	<b>8'231'343'803.29</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		7'952.24	1'939.79
Übertrag von Erträgen aus übernommenen Fonds/-anteilen		-3'925'643.21	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-162'338.71	-205'577.90
<b>Total Ertrag</b>		<b>-4'080'029.68</b>	<b>-203'638.11</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-5'776.12	-3'167.21
Reglementarische Vergütungen		-41'164'532.05	-34'148'012.50
Sonstige Aufwendungen		-80.59	-1'287.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		1'579'926.92	1'087'717.68
<b>Total Aufwand</b>		<b>-39'590'461.84</b>	<b>-33'064'749.18</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>-43'670'491.52</b>	<b>-33'268'387.29</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		477'563'770.03	292'993'834.76
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>433'893'278.51</b>	<b>259'725'447.47</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'266'215'158.73	100'199'156.80
<b>Gesamterfolg</b>		<b>2'700'108'437.24</b>	<b>359'924'604.27</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse AA CHF</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-16'617'490.34	-15'284'093.05
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		16'617'490.34	15'284'093.05
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse AA EUR</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-4'469'869.45	-4'210'874.14
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		4'469'869.45	4'210'874.14
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse AA GBP</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-103'434.59	-75'465.51
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		103'434.59	75'465.51
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse AA USD</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-11'201'311.63	-7'530'023.51
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		11'201'311.63	7'530'023.51
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse AAH CHF</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-7'871'838.75	-4'753'231.34
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		7'871'838.75	4'753'231.34
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse AAH EUR</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-2'880'574.77	-1'354'457.09
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		2'880'574.77	1'354'457.09
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse AAH GBP</b>		<b>30.09.2024</b>	<b>30.09.2023</b>
Nettoertrag		-525'971.99	-60'242.65
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		525'971.99	60'242.65
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>

## 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.
<b>Andere Anlagen</b>							<b>11'473'400'148.18</b>	<b>99.99</b>	
<b>Edelmetalle</b>									
XD0002810808	GOLDBARREN (1 UNZE) - 995/1000	0	709'759	709'759	0 USD	0.00	0.00	0.00	
XD0002811053	GOLDBARREN (1 GRAMM) - 995	149'750'011	38'625'798	27'517'655	160'858'154 CHF	71.33	11'473'400'148.18	99.99	a)
<b>Total Edelmetalle</b>							<b>11'473'400'148.18</b>	<b>99.99</b>	

**Derivative Finanzinstrumente** **611'675.76** **0.01**

### Devisentermingeschäfte

GBP/CHF	Verfall	11.10.2023	38'955	35'000	CHF/GBP	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	11.10.2023	192'523	200'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	26.10.2023	613'592	650'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	27.10.2023	1'309'959	1'380'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall	27.10.2023	76'311	70'000	CHF/GBP	0.00	0.00		
CHF/GBP	Verfall	27.11.2023	500'000	551'632	GBP/CHF	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall	27.11.2023	4'000'000	3'849'776	EUR/CHF	0.00	0.00		
CHF/GBP	Verfall	27.12.2023	445'000	485'296	GBP/CHF	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall	27.12.2023	920'000	868'600	EUR/CHF	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	28.12.2023	861'465	915'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
CHF/GBP	Verfall	28.12.2023	80'000	86'797	GBP/CHF	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall	03.01.2024	862'995	800'000	CHF/GBP	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	03.01.2024	5'521'474	5'890'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
CHF/GBP	Verfall	04.01.2024	115'000	122'814	GBP/CHF	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall	04.01.2024	65'000	60'353	EUR/CHF	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	17.01.2024	966'676	1'035'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall	17.01.2024	325'880	300'000	CHF/GBP	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	21.02.2024	403'077	425'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall	07.05.2024	330'000	322'337	EUR/CHF	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	08.05.2024	4'365'075	4'480'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	29.05.2024	1'081'060	1'090'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	21.06.2024	1'235'083	1'300'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall	21.06.2024	84'201	75'000	CHF/GBP	0.00	0.00		
GBP/CHF	Verfall	08.07.2024	655'037	570'000	CHF/GBP	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	08.07.2024	3'355'587	3'450'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall	27.08.2024	765'000	724'364	EUR/CHF	0.00	0.00		
EUR/CHF	Verfall	28.08.2024	3'489'630	3'680'000	CHF/EUR	0.00	0.00		
CHF/GBP	Verfall	04.09.2024	110'000	122'744	GBP/CHF	0.00	0.00		
CHF/EUR	Verfall	04.09.2024	190'000	178'561	EUR/CHF	0.00	0.00		
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

### Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

USD/CHF	Verfall	04.10.2023	1'157'813'500	1'265'850'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	05.10.2023	1'137'519'256	1'237'640'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	06.10.2023	1'124'589'640	1'220'850'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	10.10.2023	1'127'489'529	1'227'110'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	11.10.2023	1'124'547'887	1'230'490'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	11.10.2023	1'230'490'000	1'124'483'287	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	12.10.2023	1'122'571'745	1'228'530'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	13.10.2023	1'147'045'925	1'266'750'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	16.10.2023	1'156'679'613	1'282'330'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	17.10.2023	1'159'108'438	1'278'940'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	18.10.2023	1'177'558'369	1'301'670'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	19.10.2023	1'181'942'371	1'311'370'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	20.10.2023	1'187'960'131	1'319'510'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	23.10.2023	1'208'244'539	1'346'040'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	26.10.2023	1'205'966'812	1'345'340'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	26.10.2023	1'345'340'000	1'199'384'063	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	27.10.2023	1'226'425'209	1'375'820'000	CHF/USD	0.00	0.00
CHF/USD	Verfall	27.10.2023	1'375'820'000	1'228'149'112	USD/CHF	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall	30.10.2023	438'970'154	491'910'000	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 30.10.2023		1'217'776'079	1'364'640'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.10.2023		1'655'771'244	1'842'930'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.11.2023		1'665'042'230	1'844'730'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		1'674'090'916	1'856'590'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.11.2023		1'677'170'890	1'842'970'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.11.2023		1'667'874'854	1'832'610'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.11.2023		1'665'742'592	1'838'360'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.11.2023		1'670'464'328	1'859'760'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.11.2023		1'650'466'410	1'839'790'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.11.2023		1'631'973'870	1'812'690'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.11.2023		1'627'914'786	1'812'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.11.2023		1'628'127'728	1'810'450'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.11.2023		1'615'149'075	1'788'640'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.11.2023		1'599'922'650	1'772'960'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.11.2023		1'630'182'345	1'827'530'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.11.2023		1'615'990'780	1'824'010'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.11.2023		1'641'054'525	1'849'460'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.11.2023		1'638'159'224	1'848'010'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.11.2023		1'630'535'325	1'844'280'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.11.2023		1'659'385'108	1'880'890'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.11.2023		1'880'890'000	1'666'073'553	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.11.2023		1'647'385'703	1'859'990'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.11.2023		1'652'150'624	1'873'790'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.11.2023		1'661'032'342	1'885'680'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.12.2023		1'671'916'730	1'903'780'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		1'685'126'196	1'926'660'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.12.2023		1'664'930'246	1'914'820'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.12.2023		1'680'282'813	1'926'340'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.12.2023		1'684'756'057	1'928'040'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.12.2023		1'661'215'277	1'900'380'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.12.2023		1'660'859'906	1'901'740'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.12.2023		1'654'328'620	1'887'430'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.12.2023		1'642'666'857	1'867'520'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.12.2023		1'621'954'013	1'844'600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.12.2023		1'614'728'036	1'842'670'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.12.2023		1'611'550'751	1'840'050'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.12.2023		1'661'480'163	1'918'750'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.12.2023		1'646'926'768	1'900'010'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.12.2023		1'641'328'100	1'891'260'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.12.2023		1'647'311'494	1'917'320'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.12.2023		1'917'320'000	1'651'176'811	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.12.2023		1'646'367'710	1'911'940'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 28.12.2023		1'911'940'000	1'638'264'908	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.01.2024		1'649'463'298	1'926'610'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.01.2024		1'926'610'000	1'629'546'004	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		1'659'072'944	1'961'740'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		1'961'740'000	1'640'622'779	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2024		1'676'393'316	2'004'730'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.01.2024		1'631'864'039	1'914'630'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.01.2024		1'639'092'506	1'929'210'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.01.2024		1'656'962'570	1'955'770'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2024		1'625'002'179	1'920'130'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.01.2024		1'636'186'072	1'919'960'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.01.2024		1'625'964'707	1'910'360'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.01.2024		1'627'190'381	1'903'160'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 17.01.2024		1'903'160'000	1'619'417'876	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.01.2024		1'649'400'406	1'938'610'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.01.2024		1'626'106'289	1'890'940'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.01.2024		1'615'665'307	1'861'550'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.01.2024		1'615'385'354	1'858'910'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.01.2024		1'624'828'857	1'870'270'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.01.2024		1'620'143'591	1'863'740'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.01.2024		1'622'140'371	1'861'540'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.01.2024		1'620'714'443	1'877'920'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.01.2024		1'623'471'706	1'870'580'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.01.2024		1'616'413'229	1'872'870'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.02.2024		1'618'184'175	1'873'640'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2024		1'634'480'338	1'893'480'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.02.2024		1'644'138'434	1'917'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.02.2024		1'633'878'854	1'896'560'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.02.2024		1'626'637'909	1'879'320'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.02.2024		1'613'803'285	1'851'760'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.02.2024		1'617'874'858	1'858'950'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.02.2024		1'628'716'448	1'868'900'000	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 13.02.2024		1'617'679'924	1'849'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.02.2024		1'615'929'018	1'846'890'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.02.2024		1'606'950'392	1'834'010'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.02.2024		1'590'421'298	1'794'260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.02.2024		1'581'185'938	1'784'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.02.2024		1'600'803'010	1'818'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 21.02.2024		1'818'650'000	1'601'848'734		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.02.2024		1'590'383'646	1'805'830'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.02.2024		1'617'396'321	1'838'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.02.2024		1'616'748'586	1'835'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.02.2024		1'607'229'198	1'822'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.02.2024		1'607'210'887	1'824'480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.02.2024		1'605'609'047	1'823'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.03.2024		1'611'034'995	1'832'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.03.2024		1'609'163'345	1'829'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.03.2024		1'625'825'317	1'846'660'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.03.2024		1'620'315'984	1'830'880'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.03.2024		1'660'155'094	1'876'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.03.2024		1'684'098'121	1'908'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.03.2024		1'686'167'938	1'913'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.03.2024		1'695'522'751	1'929'110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.03.2024		1'706'260'283	1'949'310'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.03.2024		1'711'474'223	1'948'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.03.2024		1'694'745'536	1'929'800'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.03.2024		1'703'411'537	1'940'690'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.03.2024		1'696'977'214	1'920'970'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.03.2024		1'693'075'968	1'916'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.03.2024		1'689'670'146	1'906'440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.03.2024		1'682'238'286	1'894'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.03.2024		1'684'387'169	1'890'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.03.2024		1'692'169'142	1'881'890'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.03.2024		1'690'499'707	1'882'290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.03.2024		1'694'650'853	1'886'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.04.2024		1'695'361'854	1'878'790'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.04.2024		1'705'413'050	1'883'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2024		1'720'496'954	1'910'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.04.2024		1'761'695'270	1'944'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.04.2024		1'775'545'004	1'960'860'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.04.2024		1'788'626'079	1'977'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.04.2024		1'785'314'575	1'979'730'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.04.2024		1'800'879'810	1'990'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.04.2024		1'832'468'556	2'028'310'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.04.2024		1'809'675'170	1'985'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.04.2024		1'820'556'826	1'998'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.04.2024		1'859'174'736	2'041'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.04.2024		1'815'557'682	1'986'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.04.2024		1'829'797'314	2'004'830'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.04.2024		1'847'269'755	2'024'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.04.2024		1'844'171'209	2'022'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.04.2024		1'833'302'393	2'016'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.04.2024		1'797'033'415	1'972'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.04.2024		1'794'070'892	1'970'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.04.2024		1'786'230'941	1'955'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.04.2024		1'779'443'578	1'947'740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.05.2024		1'802'121'577	1'971'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'788'914'606	1'964'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.05.2024		1'776'671'863	1'937'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 07.05.2024		1'937'950'000	1'770'414'223		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.05.2024		1'757'952'306	1'924'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 08.05.2024		1'924'530'000	1'741'122'291		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2024		1'758'332'448	1'944'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.05.2024		1'779'644'436	1'963'230'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.05.2024		1'770'572'090	1'949'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.05.2024		1'819'052'325	2'004'810'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.05.2024		1'795'861'003	1'981'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.05.2024		1'804'288'953	1'991'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.05.2024		1'804'719'289	1'995'510'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.05.2024		1'816'430'238	2'008'670'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.05.2024		1'835'665'319	2'024'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.05.2024		1'854'569'999	2'040'240'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.05.2024		1'841'506'350	2'014'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.05.2024		1'794'988'723	1'964'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 29.05.2024		1'964'750'000	1'796'960'350		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.05.2024		1'787'243'303	1'954'350'000		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 31.05.2024		1'789'014'753	1'965'960'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.06.2024		1'786'775'435	1'957'340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.06.2024		1'787'191'465	1'977'870'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.06.2024		1'790'440'955	1'984'970'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.06.2024		1'778'440'195	1'983'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.06.2024		1'766'869'982	1'984'790'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.06.2024		1'783'118'300	1'994'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.06.2024		1'797'283'811	2'015'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.06.2024		1'758'290'326	1'961'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.06.2024		1'753'584'928	1'954'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.06.2024		1'764'362'621	1'962'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.06.2024		1'765'281'879	1'982'220'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.06.2024		1'754'982'862	1'962'550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.06.2024		1'764'141'991	1'981'730'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.06.2024		1'756'992'109	1'969'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 21.06.2024		1'969'530'000	1'742'167'457		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.06.2024		1'762'888'742	1'993'670'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.06.2024		1'777'731'397	1'997'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.06.2024		1'768'872'005	1'979'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.06.2024		1'765'233'376	1'975'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.06.2024		1'760'133'848	1'967'990'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.07.2024		1'740'565'254	1'940'780'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.07.2024		1'752'402'988	1'953'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.07.2024		1'756'890'066	1'955'470'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.07.2024		1'762'112'111	1'949'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.07.2024		1'755'158'911	1'943'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 08.07.2024		1'943'760'000	1'751'522'136		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.07.2024		1'783'462'676	1'979'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.07.2024		1'790'781'806	1'994'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.07.2024		1'792'693'840	1'998'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.07.2024		1'782'366'466	1'985'740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.07.2024		1'795'376'836	1'996'880'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.07.2024		1'811'964'698	2'027'710'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.07.2024		1'806'405'562	2'020'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.07.2024		1'818'898'412	2'032'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.07.2024		1'833'485'514	2'046'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.07.2024		1'863'256'345	2'103'010'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.07.2024		1'846'948'725	2'089'110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.07.2024		1'800'425'770	2'026'410'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.07.2024		1'790'136'383	2'012'900'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.07.2024		1'799'297'876	2'016'690'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.07.2024		1'811'403'927	2'050'280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.07.2024		1'767'106'745	2'008'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.07.2024		1'784'086'880	2'020'710'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2024		1'785'809'831	2'015'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.08.2024		1'784'888'139	2'015'470'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.08.2024		1'817'408'565	2'065'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.08.2024		1'838'665'498	2'140'340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.08.2024		1'784'949'438	2'102'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.08.2024		1'792'255'939	2'102'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.08.2024		1'797'214'612	2'077'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.08.2024		1'800'436'164	2'082'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.08.2024		1'814'261'404	2'098'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.08.2024		1'822'651'697	2'099'580'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.08.2024		1'839'860'220	2'126'260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.08.2024		1'827'846'513	2'117'590'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.08.2024		1'821'033'837	2'090'780'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.08.2024		1'849'786'760	2'130'590'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.08.2024		1'854'245'357	2'147'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.08.2024		1'878'402'318	2'191'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.08.2024		1'857'519'106	2'177'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 27.08.2024		2'177'950'000	1'856'136'108		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.08.2024		1'845'698'846	2'165'970'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 28.08.2024		2'165'970'000	1'838'063'802		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.08.2024		1'863'656'382	2'196'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.08.2024		1'863'383'250	2'211'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.09.2024		1'856'707'523	2'206'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.09.2024		1'873'791'700	2'208'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.09.2024		2'208'600'000	1'873'975'014		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2024		1'866'427'832	2'199'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.09.2024		1'843'234'795	2'168'930'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.09.2024		1'844'045'524	2'176'620'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.09.2024		1'863'747'178	2'197'280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.09.2024		1'852'249'933	2'200'070'000		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 12.09.2024		1'853'822'588	2'187'440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.09.2024		1'858'386'530	2'192'520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.09.2024		1'858'038'162	2'190'610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.09.2024		1'888'761'807	2'212'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.09.2024		1'914'262'000	2'258'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.09.2024		1'915'422'031	2'266'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.09.2024		1'906'504'850	2'252'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.09.2024		1'908'097'381	2'256'720'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.09.2024		1'906'405'330	2'247'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.09.2024		1'922'671'365	2'261'260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.09.2024		1'932'561'317	2'279'730'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.09.2024		1'940'543'810	2'294'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.09.2024		1'963'780'751	2'314'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.10.2024		1'957'653'376	2'309'970'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.10.2024		1'961'143'261	2'329'680'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2024		1'930'079'965	2'288'210'000		CHF/USD	527'615.73	0.00	b)
<b>Klasse AAH CHF</b>							<b>527'615.73</b>	<b>0.00</b>	
USD/EUR	Verfall 04.10.2023		340'116'042	360'130'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.10.2023		334'345'057	350'960'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.10.2023		330'067'596	345'760'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.10.2023		330'158'700	346'490'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.10.2023		329'480'266	346'990'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 11.10.2023		346'990'000	329'275'005		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.10.2023		329'043'008	346'760'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.10.2023		336'586'954	356'730'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.10.2023		339'152'777	360'360'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.10.2023		339'559'507	358'420'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.10.2023		346'319'893	363'790'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.10.2023		346'895'485	365'990'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.10.2023		348'628'780	368'760'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.10.2023		354'687'814	373'850'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.10.2023		352'890'975	372'980'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 26.10.2023		372'980'000	352'233'450		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.10.2023		358'876'390	380'030'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 27.10.2023		380'030'000	357'496'462		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.10.2023		272'639'285	289'860'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.10.2023		355'890'865	378'370'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.10.2023		630'051'959	664'260'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.11.2023		633'107'247	669'830'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.11.2023		637'166'675	676'700'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.11.2023		638'129'792	674'500'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.11.2023		634'657'046	668'820'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.11.2023		633'799'899	673'060'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.11.2023		635'310'272	681'970'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.11.2023		619'948'262	666'100'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.11.2023		612'301'052	654'240'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.11.2023		611'051'085	654'330'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.11.2023		611'648'732	655'470'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.11.2023		606'460'180	647'120'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.11.2023		600'246'014	641'690'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.11.2023		611'490'214	662'760'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.11.2023		606'848'697	659'420'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.11.2023		609'342'604	662'870'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.11.2023		608'370'746	662'360'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.11.2023		605'216'600	662'100'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.11.2023		618'022'682	675'890'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 27.11.2023		675'890'000	622'022'823		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.11.2023		610'815'298	663'740'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.11.2023		612'314'007	669'930'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.11.2023		615'843'314	673'360'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.12.2023		619'693'686	680'560'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.12.2023		610'405'975	669'970'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.12.2023		606'409'436	661'650'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.12.2023		610'366'898	661'360'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.12.2023		607'473'568	657'010'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.12.2023		599'984'822	648'310'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.12.2023		599'457'364	646'920'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.12.2023		591'148'261	637'520'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.12.2023		585'433'531	630'420'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.12.2023		580'467'935	623'680'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.12.2023		577'529'532	622'660'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.12.2023		577'142'971	623'100'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.12.2023		594'727'819	653'930'000		EUR/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/EUR	Verfall 20.12.2023		590'135'459	644'160'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.12.2023		588'358'169	642'190'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.12.2023		590'278'852	648'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 27.12.2023		648'720'000	591'196'573	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.12.2023		588'766'523	646'080'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 28.12.2023		646'080'000	587'853'146	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.01.2024		591'067'055	649'880'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 03.01.2024		649'880'000	585'182'250	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.01.2024		598'463'907	664'660'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 04.01.2024		664'660'000	598'528'577	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.01.2024		596'757'150	662'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.01.2024		583'020'021	635'860'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.01.2024		585'133'983	641'100'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.01.2024		590'492'984	648'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.01.2024		579'849'901	636'180'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.01.2024		584'515'375	638'230'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.01.2024		579'591'494	635'740'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.01.2024		580'068'808	634'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 17.01.2024		634'970'000	579'035'200	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.01.2024		588'585'292	645'470'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.01.2024		582'091'700	633'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.01.2024		576'460'136	625'480'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.01.2024		576'367'548	625'500'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.01.2024		580'128'924	631'410'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.01.2024		578'643'438	629'880'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.01.2024		579'859'053	628'130'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.01.2024		578'869'024	631'160'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.01.2024		579'689'404	627'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.01.2024		577'346'465	627'140'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.02.2024		578'724'776	624'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.02.2024		581'658'433	630'370'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.02.2024		585'086'848	635'660'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.02.2024		581'930'305	630'170'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.02.2024		578'497'133	624'890'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.02.2024		574'390'818	616'060'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.02.2024		577'555'575	620'580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.02.2024		581'116'952	625'240'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.02.2024		577'005'365	620'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.02.2024		575'248'970	620'490'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.02.2024		573'013'506	616'990'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.02.2024		567'139'975	607'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.02.2024		564'174'210	604'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.02.2024		570'782'174	614'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 21.02.2024		614'330'000	570'355'584	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.02.2024		558'680'586	601'780'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.02.2024		568'241'605	615'090'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.02.2024		568'122'825	613'930'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.02.2024		565'499'124	611'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.02.2024		566'720'105	613'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.02.2024		566'231'588	614'500'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.03.2024		568'291'797	616'550'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.03.2024		567'578'992	614'990'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.03.2024		574'075'452	621'290'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.03.2024		571'808'277	619'580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.03.2024		585'947'747	636'600'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.03.2024		590'382'113	641'890'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.03.2024		591'073'129	644'820'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.03.2024		593'955'418	649'220'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.03.2024		599'254'627	656'840'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.03.2024		602'070'742	657'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.03.2024		596'742'336	651'520'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.03.2024		598'906'287	655'520'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.03.2024		597'109'649	650'130'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.03.2024		595'079'882	647'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.03.2024		593'682'393	646'250'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.03.2024		591'549'451	642'360'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.03.2024		589'766'739	640'180'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.03.2024		594'046'736	645'250'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.03.2024		593'781'031	642'230'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.03.2024		594'854'979	644'730'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.04.2024		596'281'022	645'860'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.04.2024		592'360'275	640'960'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.04.2024		598'234'581	646'150'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.04.2024		612'068'053	659'010'000	EUR/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/EUR	Verfall 08.04.2024		614'737'780	665'410'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.04.2024		619'535'751	673'370'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.04.2024		619'590'874	670'270'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.04.2024		622'437'050	675'590'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.04.2024		633'792'116	688'200'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.04.2024		625'908'358	673'120'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.04.2024		630'768'713	675'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.04.2024		643'401'753	684'030'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.04.2024		627'527'479	666'870'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.04.2024		632'808'352	672'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.04.2024		638'204'372	678'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.04.2024		636'143'945	677'840'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.04.2024		632'477'191	674'850'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.04.2024		620'323'187	660'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.04.2024		619'042'345	662'310'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.04.2024		617'167'993	659'710'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.04.2024		615'963'300	659'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.05.2024		624'104'777	666'650'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.05.2024		619'913'861	664'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.05.2024		614'170'106	656'780'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 07.05.2024		656'780'000	614'502'246	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.05.2024		607'450'098	649'270'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 08.05.2024		649'270'000	602'962'481	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.05.2024		609'015'253	655'840'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 10.05.2024		655'840'000	608'470'566	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.05.2024		615'891'546	663'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 13.05.2024		663'920'000	617'657'457	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.05.2024		612'430'479	658'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.05.2024		630'137'037	678'340'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.05.2024		621'763'768	671'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.05.2024		624'231'015	675'790'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.05.2024		625'026'189	678'700'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 21.05.2024		678'700'000	624'350'306	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.05.2024		628'160'372	682'870'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 22.05.2024		682'870'000	627'839'838	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.05.2024		633'973'387	689'570'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.05.2024		641'445'104	696'670'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.05.2024		636'914'282	690'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.05.2024		621'727'631	673'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 29.05.2024		673'110'000	620'635'287	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.05.2024		617'649'337	669'900'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.05.2024		618'742'213	672'910'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.06.2024		618'981'266	669'440'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.06.2024		618'458'286	670'530'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.06.2024		619'547'847	672'640'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.06.2024		616'277'551	669'890'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.06.2024		612'208'696	666'080'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.06.2024		616'573'536	670'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.06.2024		619'617'150	674'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.06.2024		606'282'863	655'510'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.06.2024		604'395'912	648'790'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.06.2024		607'496'353	651'480'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.06.2024		608'534'956	660'230'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.06.2024		606'766'733	653'580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.06.2024		609'812'463	651'770'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.06.2024		608'135'850	651'710'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 21.06.2024		651'710'000	606'834'583	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.06.2024		609'643'014	654'820'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.06.2024		616'543'015	661'120'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.06.2024		612'383'315	654'150'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.06.2024		610'603'652	655'240'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.06.2024		608'774'312	651'450'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.07.2024		602'499'188	643'630'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.07.2024		609'044'233	652'470'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.07.2024		609'580'996	653'380'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.07.2024		611'713'727	656'430'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.07.2024		609'911'658	655'290'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 08.07.2024		655'290'000	606'469'227	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.07.2024		618'804'093	668'650'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.07.2024		622'160'226	673'490'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.07.2024		622'424'848	674'430'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.07.2024		619'664'165	670'230'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.07.2024		623'866'160	675'400'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.07.2024		630'880'613	686'400'000	EUR/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/EUR	Verfall 17.07.2024		629'045'771	686'260'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.07.2024		633'200'022	691'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.07.2024		639'125'076	695'370'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.07.2024		648'865'190	709'440'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.07.2024		644'011'056	702'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.07.2024		628'014'799	683'910'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.07.2024		625'391'019	680'740'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.07.2024		628'726'422	681'950'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.07.2024		633'590'824	687'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.07.2024		617'123'538	669'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.07.2024		624'029'717	677'510'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 02.08.2024		675'510'000	625'211'717	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.08.2024		624'510'592	675'510'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.08.2024		624'586'458	674'930'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 05.08.2024		674'930'000	623'693'573	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.08.2024		635'924'465	688'200'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.08.2024		644'352'441	703'860'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.08.2024		624'744'126	685'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.08.2024		625'441'854	683'860'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.08.2024		626'298'635	684'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.08.2024		629'003'463	686'150'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.08.2024		634'005'948	692'590'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.08.2024		639'184'160	698'790'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.08.2024		645'147'159	706'890'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.08.2024		641'187'913	707'690'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.08.2024		637'552'303	700'290'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.08.2024		648'988'994	713'370'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.08.2024		650'028'510	719'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.08.2024		659'258'879	732'610'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.08.2024		651'421'598	724'900'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 27.08.2024		724'900'000	652'187'604	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.08.2024		647'432'760	719'650'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 28.08.2024		719'650'000	643'745'919	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.08.2024		653'303'976	730'370'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.08.2024		654'247'744	730'640'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.09.2024		652'672'884	726'530'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.09.2024		656'948'745	727'350'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 04.09.2024		727'350'000	657'141'050	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.09.2024		655'753'848	725'850'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.09.2024		647'121'763	714'580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.09.2024		647'263'136	718'020'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.09.2024		654'360'258	725'040'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.09.2024		650'576'483	723'470'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.09.2024		651'584'022	719'540'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.09.2024		652'999'551	719'550'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.09.2024		653'441'583	719'580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.09.2024		662'975'019	732'000'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.09.2024		670'938'632	744'080'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.09.2024		672'794'172	748'500'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.09.2024		670'180'845	745'540'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.09.2024		670'089'950	745'070'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.09.2024		670'354'571	746'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.09.2024		678'755'912	756'410'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.09.2024		683'818'569	761'300'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.09.2024		685'630'560	764'620'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.09.2024		693'872'802	775'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.10.2024		691'027'205	771'630'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.10.2024		692'804'559	774'560'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.10.2024		687'459'595	767'230'000	EUR/USD		80'368.19	0.00	b)
<b>Klasse AAH EUR</b>							<b>80'368.19</b>	<b>0.00</b>	
USD/GBP	Verfall 04.10.2023		13'256'862	16'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.10.2023		13'019'276	15'780'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.10.2023		12'907'777	15'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.10.2023		12'908'146	15'640'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.10.2023		12'869'870	15'650'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 11.10.2023		15'650'000	12'838'813	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.10.2023		12'855'115	15'670'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.10.2023		13'149'298	16'120'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.10.2023		13'263'095	16'330'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.10.2023		13'296'217	16'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.10.2023		13'535'233	16'430'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.10.2023		13'551'881	16'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.10.2023		13'618'800	16'590'000	GBP/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/GBP	Verfall 23.10.2023		13'871'943	16'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.10.2023		13'827'317	16'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 26.10.2023		16'790'000	13'818'816	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.10.2023		14'065'624	17'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 27.10.2023		17'090'000	13'997'779	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.10.2023		63'737'932	77'820'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.10.2023		13'964'685	17'050'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.10.2023		77'979'798	94'570'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.11.2023		78'417'553	95'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.11.2023		78'914'528	95'930'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.11.2023		78'852'843	95'680'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.11.2023		78'722'362	95'440'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.11.2023		78'469'286	95'530'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.11.2023		78'658'768	97'330'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.11.2023		78'411'814	97'160'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.11.2023		77'302'141	95'070'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.11.2023		77'134'610	94'780'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.11.2023		77'137'874	94'780'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.11.2023		76'533'384	93'340'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.11.2023		76'113'984	93'270'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.11.2023		77'553'574	96'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.11.2023		76'925'859	95'720'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.11.2023		77'990'900	97'030'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.11.2023		77'990'974	96'970'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.11.2023		77'526'639	96'870'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.11.2023		79'117'205	99'200'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 27.11.2023		99'200'000	79'615'406	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.11.2023		78'226'324	97'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.11.2023		78'245'152	98'700'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.11.2023		78'848'671	99'410'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.12.2023		79'151'762	100'390'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.12.2023		80'112'834	101'730'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.12.2023		79'437'648	100'560'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.12.2023		80'055'787	101'140'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.12.2023		79'103'886	99'750'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.12.2023		78'171'645	98'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.12.2023		78'063'368	98'310'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.12.2023		78'046'903	98'140'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.12.2023		77'338'922	97'010'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.12.2023		76'696'344	96'250'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.12.2023		76'126'474	95'630'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.12.2023		75'073'253	94'030'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.12.2023		77'328'212	98'680'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.12.2023		77'045'528	97'840'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.12.2023		76'765'002	97'050'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.12.2023		77'291'630	98'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 27.12.2023		98'470'000	77'738'042	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.12.2023		77'097'971	97'660'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 28.12.2023		97'660'000	77'170'469	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.01.2024		77'414'155	97'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 03.01.2024		97'980'000	76'618'106	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.01.2024		78'400'462	100'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 04.01.2024		100'260'000	78'515'827	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.01.2024		78'076'698	99'700'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.01.2024		76'576'778	96'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.01.2024		76'608'018	97'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.01.2024		77'285'473	98'560'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.01.2024		75'898'039	96'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.01.2024		76'467'764	97'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.01.2024		75'995'920	96'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.01.2024		76'088'581	96'720'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 17.01.2024		96'720'000	75'786'900	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.01.2024		77'196'631	98'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.01.2024		76'326'648	96'580'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.01.2024		75'524'166	95'600'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.01.2024		75'603'463	95'810'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.01.2024		76'107'726	96'510'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.01.2024		75'927'571	96'570'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.01.2024		76'077'688	96'360'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.01.2024		75'905'523	96'820'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.01.2024		76'055'148	96'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.01.2024		75'819'571	96'450'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.02.2024		75'887'214	96'210'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.02.2024		76'630'923	97'070'000	GBP/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/GBP	Verfall 05.02.2024		77'099'991	98'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.02.2024		76'669'467	97'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.02.2024		76'258'167	96'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.02.2024		75'838'598	94'950'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.02.2024		76'163'521	95'800'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.02.2024		76'557'471	96'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.02.2024		76'104'660	95'930'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.02.2024		75'917'144	95'910'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.02.2024		75'624'197	95'400'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.02.2024		74'732'164	94'170'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.02.2024		74'466'780	93'450'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.02.2024		75'187'492	94'640'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 21.02.2024		94'640'000	75'198'246	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.02.2024		74'291'844	93'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.02.2024		75'500'338	95'600'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.02.2024		75'548'198	95'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.02.2024		75'336'714	95'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.02.2024		75'548'931	95'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.02.2024		75'441'531	95'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.03.2024		75'716'186	96'040'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.03.2024		75'665'013	95'740'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.03.2024		76'433'635	96'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.03.2024		76'124'239	96'320'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.03.2024		78'060'035	99'130'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.03.2024		79'398'675	101'100'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.03.2024		79'638'360	101'510'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.03.2024		79'975'294	102'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.03.2024		80'715'901	103'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.03.2024		81'188'505	103'970'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.03.2024		80'334'793	102'700'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.03.2024		80'666'648	103'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.03.2024		80'404'769	102'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.03.2024		79'919'931	101'810'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.03.2024		79'696'827	101'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.03.2024		79'624'073	101'210'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.03.2024		79'677'200	101'280'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.03.2024		80'414'013	101'870'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.03.2024		80'225'488	101'100'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.03.2024		80'370'544	101'630'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.04.2024		80'518'537	101'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.04.2024		80'980'571	102'280'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.04.2024		81'808'284	103'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.04.2024		83'655'575	105'140'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.04.2024		84'042'137	106'060'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.04.2024		84'748'907	107'370'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.04.2024		84'714'184	106'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.04.2024		85'604'463	108'270'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.04.2024		87'123'867	110'440'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.04.2024		86'127'037	108'220'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.04.2024		86'755'733	108'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.04.2024		88'756'944	110'380'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.04.2024		86'634'503	107'860'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.04.2024		87'565'864	108'960'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.04.2024		88'267'902	109'910'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.04.2024		88'051'356	109'580'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.04.2024		88'031'851	109'450'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.04.2024		86'067'739	106'130'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.04.2024		85'980'740	106'910'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.04.2024		85'722'892	106'580'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.04.2024		85'532'352	106'840'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.05.2024		86'750'263	108'110'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 02.05.2024		108'110'000	86'157'843	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.05.2024		86'053'692	107'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 03.05.2024		107'980'000	86'239'807	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.05.2024		85'207'556	106'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.05.2024		84'421'373	105'400'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.05.2024		84'620'479	106'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 10.05.2024		106'180'000	84'584'684	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.05.2024		86'080'334	108'060'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 13.05.2024		108'060'000	86'497'130	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.05.2024		85'055'495	106'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.05.2024		87'558'492	109'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.05.2024		86'419'326	108'560'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.05.2024		86'761'366	109'230'000	GBP/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/GBP	Verfall 21.05.2024		86'834'158	109'840'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 21.05.2024		109'840'000	86'699'134	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.05.2024		87'550'980	110'920'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 22.05.2024		110'920'000	87'344'772	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.05.2024		88'336'343	112'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.05.2024		89'458'627	113'820'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.05.2024		88'889'972	113'110'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.05.2024		85'823'336	109'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.05.2024		85'201'692	108'530'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.05.2024		85'559'782	109'330'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.06.2024		85'471'833	108'670'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.06.2024		85'433'790	108'840'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.06.2024		85'661'396	109'070'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.06.2024		85'117'077	108'720'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.06.2024		84'593'114	108'110'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.06.2024		85'270'868	108'800'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.06.2024		85'984'651	109'830'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.06.2024		84'097'096	106'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.06.2024		83'793'282	106'560'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.06.2024		84'320'508	107'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.06.2024		84'585'990	108'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.06.2024		84'145'386	107'420'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.06.2024		84'753'792	107'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.06.2024		84'369'085	106'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 21.06.2024		106'980'000	84'295'294	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.06.2024		84'703'227	107'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.06.2024		85'521'560	108'490'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.06.2024		85'031'939	107'370'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.06.2024		84'740'152	107'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.06.2024		84'642'096	107'250'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.07.2024		83'742'500	105'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.07.2024		84'591'548	107'010'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.07.2024		84'735'406	107'120'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.07.2024		85'027'773	107'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.07.2024		84'765'351	107'450'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 08.07.2024		107'450'000	84'194'607	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.07.2024		85'964'769	109'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.07.2024		86'465'284	110'660'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.07.2024		86'477'767	110'970'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.07.2024		86'138'459	110'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.07.2024		86'700'607	111'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.07.2024		87'627'305	113'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.07.2024		87'388'955	113'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.07.2024		88'030'067	114'300'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.07.2024		88'846'326	115'040'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.07.2024		90'182'794	117'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.07.2024		89'501'060	116'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.07.2024		87'372'251	112'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.07.2024		86'982'077	112'320'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.07.2024		87'364'017	112'780'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.07.2024		88'046'021	113'750'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.07.2024		85'888'475	110'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.07.2024		86'749'856	111'510'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.08.2024		86'797'514	111'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 02.08.2024		111'500'000	86'919'917	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.08.2024		86'800'413	111'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 05.08.2024		111'350'000	86'686'752	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.08.2024		88'180'387	113'270'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.08.2024		89'933'155	115'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.08.2024		87'129'030	111'160'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.08.2024		86'417'392	109'820'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.08.2024		86'468'039	110'010'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.08.2024		86'887'587	110'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.08.2024		87'391'329	111'540'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.08.2024		88'181'311	112'760'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.08.2024		89'010'776	114'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.08.2024		88'526'279	113'800'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.08.2024		88'040'155	113'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.08.2024		89'572'985	115'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.08.2024		89'748'496	116'550'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.08.2024		91'098'989	118'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.08.2024		90'012'495	117'570'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.08.2024		89'421'462	117'160'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.08.2024		90'301'325	119'120'000	GBP/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/GBP Verfall 30.08.2024		90'318'423	119'540'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 03.09.2024		90'174'287	119'160'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 04.09.2024		90'709'411	119'350'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	GBP/USD Verfall 04.09.2024		119'350'000	90'817'087		USD/GBP	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 05.09.2024		90'587'567	119'050'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 06.09.2024		89'452'379	117'120'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 09.09.2024		89'524'501	117'830'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 10.09.2024		90'390'929	118'940'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 11.09.2024		90'132'334	118'790'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 12.09.2024		90'105'521	117'840'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 13.09.2024		90'233'558	117'800'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 16.09.2024		90'454'242	117'720'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 17.09.2024		91'519'256	119'720'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 18.09.2024		92'638'275	121'860'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 19.09.2024		93'049'016	122'810'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 20.09.2024		92'719'903	122'260'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 23.09.2024		92'700'410	122'480'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 24.09.2024		92'595'667	122'710'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 25.09.2024		93'771'506	124'540'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 26.09.2024		94'500'727	126'170'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 27.09.2024		94'870'452	127'010'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 30.09.2024		95'938'736	128'310'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 01.10.2024		95'563'889	128'030'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 02.10.2024		95'739'778	128'370'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 03.10.2024		94'454'410	126'690'000		GBP/USD	3'691.84	0.00	b)	
<b>Klasse AAH GBP</b>								<b>3'691.84</b>	<b>0.00</b>	
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>								<b>611'675.76</b>	<b>0.01</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	756'146.44	0.01
Andere Anlagen - Edelmetalle	11'473'400'148.18	99.99
Derivative Finanzinstrumente	611'675.76	0.01
Sonstige Vermögenswerte	14'334.89	0.00
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>11'474'782'305.27</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-3'813'327.58	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>11'470'968'977.69</b>	

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);	11'473'400'148.18	99.99
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	611'675.76	0.01
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

EUR	1 = CHF	0.94144104
GBP	1 = CHF	1.13149579
USD	1 = CHF	0.84355000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)		-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)		2'684'285'761.50	23.40

## 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)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
AA EUR	CHF	-	-	-	-
AA GBP	CHF	-	-	-	-
AA USD	CHF	-	-	-	-
AAH CHF	CHF	-	-	-	-
AAH EUR	CHF	-	-	-	-
AAH GBP	CHF	-	-	-	-

## 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
AA CHF	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AA EUR	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AA GBP	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AA USD	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AAH CHF	0.400	1.050	0.300	0.100	-
AAH EUR	0.400	1.050	0.300	0.100	-
AAH GBP	0.400	1.050	0.300	0.100	-

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

Dieser Fonds 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 Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 22.01.2025

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 27.01.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	-	-	-
AA EUR	Nein	CHF	-	-	-
AA GBP	Nein	CHF	-	-	-
AA USD	Nein	CHF	-	-	-
AAH CHF	Nein	CHF	-	-	-
AAH EUR	Nein	CHF	-	-	-
AAH GBP	Nein	CHF	-	-	-

## 11 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 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.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert des Anlagefonds 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 Anlagefonds berechnet. Für Tage, an welchen der Goldhandel in London geschlossen ist (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens statt.
2. Der Wert des Goldes wird aufgrund der Nachmittags-Schlusskurse des Goldhandels in London (LBMA Gold Price PM in USD) berechnet.
3. Die als Bankguthaben gehaltenen flüssigen Mittel werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit der neuen Markttrendite angepasst.
4. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 1/100 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
5. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Anlagefonds 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 Nettofondsvermögen, getätigt wurden.

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

### des **ZKB Gold ETF**

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend der "Anlagefonds")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, den Fondsvertrag des Anlagefonds zu ändern.

Die Änderung betrifft die Belastung der Pauschalkommission (PVK) zulasten des Fondsvermögens. Neu wird die Pauschalkommission monatlich, und nicht wie bisher jeweils am Quartalsende, in Rechnung gestellt (vgl. Anpassung in § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages).

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Anlagefonds, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 27. Oktober 2023

#### **Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

#### **Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

### des **Swisscanto ETF Precious Metal**

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend "Umbrella-Fonds")

mit dem Teilvermögen

### **Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold**

(nachfolgend "übertragendes Teilvermögen")

### und des **ZKB Gold ETF**

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"  
(nachfolgend "übernehmender Anlagefonds")

betreffend

## **Vereinigung vom 23. Oktober 2023**

Zur Bekanntgabe:

1. des Vollzuges der Vereinigung;
2. der Umtauschverhältnisse; und
3. der Bestätigung der Prüfgesellschaft.

### 1 Vollzug der Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, haben das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Anlagefonds per 23. Oktober 2023 vereinigt. Die Anleger wurden mittels Publikation vom 23. August 2023 in den Publikationsorganen der von der Vereinigung betroffenen Teilvermögen bzw. Anlagefonds über die geplante Vereinigung und über deren Ablauf informiert. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wurde das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst. Seit dem 23. Oktober 2023 gelten die fondsvertraglichen Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds auch für das übertragende Teilvermögen.

### 2 Umtauschverhältnisse

Die Fondsleitung ermittelte das Umtauschverhältnis, welches von der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft Ernst & Young AG geprüft und für korrekt befunden wurde.

#### 2.1 Berechnungsgrundlagen

Die Anleger des übertragenden Teilvermögens erhalten Anteile am übernehmenden Anlagefonds in entsprechender Höhe. Die Berechnung der Umtauschverhältnisse für die Vereinigung basiert auf den nachfolgend aufgeführten Nettoinventarwerten (NAV) per 23. Oktober 2023:

**Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold**

(übertragendes Teilvermögen)

Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
A	CH0044781141	USD 1'849.75
A (CHF)	CH0044781232	CHF 1'529.12
A (EUR)	CH0044781174	EUR 1'162.23
A (GBP)	CH0103447766	GBP 1'021.86
AX	CH0044781257	USD 1'863.16
AX (CHF)	CH0044821731	CHF 1'540.31
AX (EUR)	CH0044821699	EUR 1'170.69
AX (GBP)	CH0103447790	GBP 1'029.12

**ZKB Gold ETF**

(übernehmender Anlagefonds)

Anteilsklasse	ISIN	NAV pro Anteil
AA USD	CH0047533549	USD 1'856.30
AAH CHF	CH0139101601	CHF 456.06
AAH EUR	CH0103326762	EUR 1'039.12
AAH GBP	CH0104493306	GBP 1'054.19
AA USD	CH0047533549	USD 1'856.30
AAH CHF	CH0139101601	CHF 456.06
AAH EUR	CH0103326762	EUR 1'039.12
AAH GBP	CH0104493306	GBP 1'054.19

**2.2 Umtauschverhältnisse**

Entsprechend ergibt sich das folgende Umtauschverhältnis jeweils aus Sicht des übertragenden Teilvermögens (1 Anteil des übertragenden Teilvermögens ↔ Anzahl Anteile am übernehmenden Anlagefonds):

**Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold**

(übertragendes Teilvermögen)

Anteilsklasse	Umtauschverhältnis <sup>1</sup>
A	1 ↔ 0.9964723416
A (CHF)	1 ↔ 3.3529068604
A (EUR)	1 ↔ 1.1184708029
A (GBP)	1 ↔ 0.9693324949
AX	1 ↔ 1.0036919959
AX (CHF)	1 ↔ 3.3774389344
AX (EUR)	1 ↔ 1.1266090074
AX (GBP)	1 ↔ 0.9762132886

<sup>1</sup> Die Berechnung der Anteile erfolgt auf 3 Nachkommastellen genau.

**3 Bestätigung der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft**

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG bestätigte am 27. Oktober 2023 die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung wie folgt:

"Für die Berechnung der Umtauschverhältnisse ist die Fondsleitung verantwortlich, während unsere Aufgabe darin besteht, die Berechnung der Umtauschverhältnisse zu prüfen und zu beurteilen.

Unsere Prüfung erfolgte nach den Schweizer Prüfungsstandards, wonach eine Prüfung so zu planen und durchzuführen ist, dass wesentliche Fehlaussagen in der Berechnung der Umtauschverhältnisse mit angemessener Sicherheit erkannt werden. Wir prüften die Grundlagen der Berechnung der Umtauschverhältnisse mittels Analysen und Erhebungen auf der Basis von Stichproben. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine ausreichende Grundlage für unser Urteil bildet.

Gemäss unserer Beurteilung wurde die Berechnung der Umtauschverhältnisse korrekt vorgenommen und die Vereinigung gemäss Art. 114 und 115 KKV sowie gemäss den Fondsverträgen ordnungsgemäss durchgeführt.

Ernst & Young AG  
Patrik-Arthur Schwaller, Yves Lauber"

\*\*\*

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds Swisscanto ETF Precious Metal und des Anlagefonds ZKB Gold ETF, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 14. November 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich