

# SWISSCANTO (CH) VORSORGE FONDS 75 PASSIV

## Jahresbericht per 30.09.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
DT CHF	35369084	CHF
FA CHF	35369079	CHF
VT CHF	35369090	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 20 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 45 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 75 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 95 Passiv

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigegeführten Jahresrechnungen 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 Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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



### **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnungen**

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



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

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

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

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeits, 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

**Beilage**

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2023, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
12	Fussnoten	15
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
14	Pflichtpublikationen	18

# 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 (ab 03.01.2023)  
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	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		107'631'204.25	72'549'735.87	64'130'863.00	38'986'784.42
<b>Klasse DT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'348'187.47	1'746'303.19	1'027'190.37	183'695.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		18'222.396	14'574.396	7'213.000	1'554.555
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		128.86	119.82	142.41	118.17
Thesaurierung je Anteil		1.93	1.80	1.40	1.91
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.42 %	0.42 %	0.42 %	0.42 %
<b>Klasse FA CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'010'658.73	1'671'175.79	1'859'734.96	982'733.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		16'589.217	14'636.978	13'667.752	8'612.922
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		121.20	114.17	136.07	114.10
Ausschüttung je Anteil		1.10	1.45	-	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.04 %	1.04 %	1.04 %	1.04 %
<b>Klasse VT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		103'272'358.05	69'132'256.89	61'243'937.67	37'820'355.81
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		780'190.256	564'406.227	422'166.385	315'844.495
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		132.37	122.49	145.07	119.74
Thesaurierung je Anteil		1.99	1.84	1.41	1.82
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.42 %	0.42 %	0.42 %	0.42 %

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

### Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF	8.06 %	-15.64 %	16.06 %	7.25 %
Klasse FA CHF	7.40 %	-16.16 %	15.35 %	6.59 %
Klasse QT CHF (Lancierung 05.11.2019, Schliessung 02.09.2020)	-	-	-	1.40 %
Klasse VT CHF	8.07 %	-15.64 %	16.06 %	7.27 %

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)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	5'526.13	129'247.22
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	107'813'402.40	72'096'988.22
Derivative Finanzinstrumente	-113'551.70	-105'842.60
Sonstige Vermögenswerte	621'309.75	453'660.51
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>108'326'686.58</b>	<b>72'574'053.35</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-661'562.73	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-33'919.60	-24'317.48
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>107'631'204.25</b>	<b>72'549'735.87</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse DT CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'574.396	7'213.000
Ausgegebene Anteile		4'336.000	8'370.396
Zurückgenommene Anteile		-688.000	-1'009.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>18'222.396</b>	<b>14'574.396</b>

Klasse FA CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'636.978	13'667.752
Ausgegebene Anteile		2'119.309	2'291.226
Zurückgenommene Anteile		-167.070	-1'322.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>16'589.217</b>	<b>14'636.978</b>

Klasse VT CHF	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		564'406.227	422'166.385
Ausgegebene Anteile		272'425.578	187'636.953
Zurückgenommene Anteile		-56'641.549	-45'397.111
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>780'190.256</b>	<b>564'406.227</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		72'549'735.87	64'130'863.00
Ausbezahlte Ausschüttung		-21'515.07	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-9'677.51	-3'707.57
Saldo aus dem Anteilverkehr		29'057'434.07	21'101'454.90
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		6'055'226.89	-12'678'874.46
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>107'631'204.25</b>	<b>72'549'735.87</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		41.62	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-0.22	-219.30
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		1'775'170.31	1'296'172.90
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		234'793.00	87'341.72
<b>Total Ertrag</b>		<b>2'010'004.71</b>	<b>1'383'295.32</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-2'219.56	-1'581.55
Reglementarische Vergütungen		-360'819.02	-288'996.15
Sonstige Aufwendungen		-984.10	-897.90
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-38'267.81	-8'231.59
<b>Total Aufwand</b>		<b>-402'290.49</b>	<b>-299'707.19</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>1'607'714.22</b>	<b>1'083'588.13</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-35'005.89	801'703.86
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		49'271.79	34'519.46
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>1'621'980.12</b>	<b>1'919'811.45</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		4'433'246.77	-14'598'685.91
<b>Gesamterfolg</b>		<b>6'055'226.89</b>	<b>-12'678'874.46</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse DT CHF</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	35'349.23	26'355.27
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>35'349.23</b>	<b>26'355.27</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	12'372.23	9'224.34
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	22'977.00	17'130.93
<b>Total</b>	<b>35'349.23</b>	<b>26'355.27</b>
<b>Klasse FA CHF</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	17'911.10	13'870.30
Vortrag des Vorjahres	633.42	7'986.74
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>18'544.52</b>	<b>21'857.04</b>
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	18'248.14	21'223.62
Vortrag auf neue Rechnung	296.38	633.42
<b>Total</b>	<b>18'544.52</b>	<b>21'857.04</b>
<b>Klasse VT CHF</b>	<b>30.09.2023</b>	<b>30.09.2022</b>
Nettoertrag	1'554'453.89	1'043'362.56
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>1'554'453.89</b>	<b>1'043'362.56</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'554'453.89	1'043'362.56
<b>Total</b>	<b>1'554'453.89</b>	<b>1'043'362.56</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>							<b>107'813'402.40</b>	<b>99.53</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>107'813'402.40</b>	<b>99.53</b>	
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	4'572	1'768	148	6'191 CAD	178.40	747'370.59	0.69	a)
<b>CAD</b>							<b>747'370.59</b>	<b>0.69</b>	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	18'478	3'810	9'914	12'374 CHF	141.36	1'749'228.41	1.61	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	4'385	1'689	79	5'995 CHF	119.79	718'163.08	0.66	a)
CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	25'778	10'384	780	35'382 CHF	106.11	3'754'192.52	3.47	a)
CH0117045127	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT	15'269	6'295	614	20'950 CHF	102.91	2'155'882.97	1.99	a)
CH0117045317	SWC (CH) IBF WORLD EX CHF GOVT. (I) NTH1 CHF	11'498	5'534	0	17'032 CHF	93.11	1'585'900.34	1.46	a)
CH0117048352	SWC (CH) INDEX BF WLD EX JPY/CHF INFL.-L. NTH1 CHF	13'164	6'824	0	19'988 CHF	104.57	2'090'151.54	1.93	a)
CH0117052453	SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF	591	558	0	1'149 CHF	97.00	111'485.60	0.10	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	25'225	12'346	2'333	35'237 CHF	156.48	5'513'809.19	5.09	a)
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	60'402	41'178	4'578	97'002 CHF	49.40	4'791'567.43	4.42	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	29'868	13'199	2'468	40'599 CHF	291.54	11'836'255.70	10.93	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	81'859	35'667	4'794	112'733 CHF	152.93	17'240'293.43	15.92	a)
CH0324760229	SWC (CH) INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH NT CHF	52'291	25'896	2'212	75'975 CHF	142.06	10'793'252.11	9.96	a)
CH0398970274	SWC (CH) IX BF EMMA HARD CURRENCY NTH1 CHF	4'820	2'054	37	6'836 CHF	76.48	522'872.75	0.48	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	18'758	6'899	1'088	24'569 CHF	127.43	3'130'815.70	2.89	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	66'932	32'179	367	98'743 CHF	87.87	8'676'359.56	8.01	a)
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	8'457	3'089	75	11'472 CHF	93.18	1'068'945.59	0.99	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	0	16	0	16 CHF	112'187.40	1'754'050.07	1.62	a)
<b>CHF</b>							<b>77'493'225.99</b>	<b>71.54</b>	
CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	4'009	1'950	0	5'959 EUR	113.79	656'699.34	0.61	a)
<b>EUR</b>							<b>656'699.34</b>	<b>0.61</b>	
CH0117044807	SWC (CH) INDEX EF JAPAN NT	6'060	1'158	3'085	4'132 JPY	29'048.60	735'905.24	0.68	a)
CH1224025580	SWC (CH) IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	0	10	0	10 JPY	12'214'254.18	735'372.23	0.68	a)
<b>JPY</b>							<b>1'471'277.47</b>	<b>1.36</b>	
CH0117044690	SWC (CH) INDEX EF USA NT USD	34'728	7'081	18'012	23'797 USD	374.77	8'158'769.55	7.53	a)
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	8'733	3'918	101	12'550 USD	120.80	1'386'907.93	1.28	a)
CH0140549228	SWC (CH) INDEX EF MSCI@ WORLD EX SWITZERLAND NT USD	30'553	11'883	805	41'631 USD	255.78	9'741'238.36	8.99	a)
CH1224024922	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE ST USD	0	80	1	79 USD	113'161.62	8'157'913.17	7.53	a)
<b>USD</b>							<b>27'444'829.01</b>	<b>25.34</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-113'551.70</b>	<b>-0.10</b>	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	USD/CHF	Verfall 02.11.2022	11'929'525	12'239'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall 02.11.2022	1'663'754	1'735'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	685'752	630'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF	Verfall 02.11.2022	929'565	137'250'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF	Verfall 02.11.2022	324'334	512'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF	Verfall 02.11.2022	540'507	759'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF	Verfall 02.11.2022	137'655	1'569'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF	Verfall 02.11.2022	108'054	838'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF	Verfall 02.11.2022	32'221	352'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF	Verfall 02.11.2022	117'435	944'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF	Verfall 02.11.2022	55'216	81'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF	Verfall 02.11.2022	16'640	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		8'851	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		38'824	39'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		4'840	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		6'625	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		12'588	13'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		3'126	5'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		112'646	113'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		5'785	8'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		7'480	1'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		16'631	17'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		3'753	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		7'896	7'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		138'272	138'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		11'497	1'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		6'499	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		32'143	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		17'722	18'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		357'104	559'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		595'547	815'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		122'469	920'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		12'808'998	12'854'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		156'805	1'726'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		57'844	82'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		1'875'976	1'893'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		759'035	658'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		112'295	884'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		987'433	146'250'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.12.2022		36'794	383'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		4'953	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		52'074	53'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		21'239	22'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		14'607	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		3'132	35'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		21'055	3'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		10'715	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		6'980	11'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		161'167	169'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		32'532	33'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		44'730	47'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		10'772	11'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		3'369	500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		5'911	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		27'584	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		13'232'300	13'964'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		2'073'185	2'107'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		813'487	716'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		397'282	624'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		620'252	888'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		166'639	1'852'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2023		38'036	401'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		135'391	1'024'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		124'884	1'029'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		64'956	94'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		7'879	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		130'032	139'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		3'426	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		4'408	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		3'438	5'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		19'598	21'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		19'392	21'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		4'583	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		10'828	11'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		4'945	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		46'516	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		14'903	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		45'534	49'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		3'944	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		13'982	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		14'840	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		26'776	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		4'925	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		1'103'509	160'682'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		8'928	1'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		3'411	500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		3'518	500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		596'952	878'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		398'070	636'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		67'207	98'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		164'877	1'867'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2023		38'195	409'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		145'491	1'231'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		1'106'669	157'982'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		12'705'877	13'801'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		817'815	736'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		2'061'827	2'096'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		145'257	1'098'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		16'905	2'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		4'417	50'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		9'593	14'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		243'748	263'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		48'242	49'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		22'339	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		6'359	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		3'840	29'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'929	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		20'158	22'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		33'381	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		5'726	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		10'025	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		24'041	26'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		82'970	91'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		3'401	5'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		13'839	14'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		4'524	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		6'402	900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		11'959	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		13'029	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		4'824	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		9'891	1'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		101'414	110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		3'244	5'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		5'704	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		11'992	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		3'679	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		18'008	18'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		10'151	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		3'927	6'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		14'301'690	15'474'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		2'388'480	2'385'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		907'063	796'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		1'220'879	171'471'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		675'974	982'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		454'172	699'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.03.2023		39'048	422'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		155'527	1'155'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		187'285	2'108'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		73'763	105'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.03.2023		159'471	1'351'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		108'526	118'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		6'699	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		30'589	31'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		6'940	1'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		9'207	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		100'000	92'519		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.03.2023		5'000	3'189		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.03.2023		1'000'000	6'874		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.03.2023		13'000	12'855		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.03.2023		7'000	4'799		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.03.2023		5'000	5'616		GBP/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		191'485	2'124'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		14'168'748	15'154'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		901'775	801'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		2'386'330	2'403'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		1'183'347	172'379'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		147'070	1'232'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		162'504	1'218'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		658'769	958'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		428'801	683'000		CHF/AUD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		71'379	103'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		39'093	432'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		14'000	13'107		USD/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		8'960	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		3'160	5'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		67'559	72'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		3'367	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		7'978	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		11'187	10'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		10'295	1'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		3'132	5'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		14'912	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		113'393	122'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		5'463	8'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		6'098	10'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		12'696	19'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		3'134	24'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		25'061	3'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		36'954	38'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		270'146	293'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		3'731	43'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		16'643	15'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		48'388	53'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		4'982	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		8'255	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		174'199	1'305'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		73'455	107'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2023		150'791	1'297'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		657'560	977'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		420'541	689'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		14'543'070	15'959'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		37'726	430'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		2'467'897	2'482'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		187'869	2'131'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		924'710	819'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		4'550	5'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		11'925	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		4'531	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		58'800	65'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		37'604	42'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		7'097	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		21'416	24'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		65'490	73'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		9'801	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		4'438	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		20'618	23'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		40'375	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		15'743	16'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		1'247'660	181'352'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		5'346	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		14'691'475	16'480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		2'557'846	2'603'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		968'691	870'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		1'248'449	189'245'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		671'346	1'027'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		151'151	1'329'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		197'309	2'276'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		180'863	1'372'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		38'239	457'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		431'410	733'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		13'269	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		2'938	3'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		10'611	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		7'924	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		15'114	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		9'907	1'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		6'000	6'705		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		17'000	16'486		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		5'000	3'331		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		78'000	70'150		USD/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		74'066	111'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		15'410'318	16'987'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		2'508'467	2'584'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		951'176	847'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		1'336'860	204'745'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		666'961	1'002'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		424'944	722'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		189'956	2'284'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		36'107	447'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		183'227	1'406'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		143'171	1'235'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		73'056	109'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		5'862	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		8'130	9'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		3'584	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		10'772	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		5'876	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		36'650	41'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		16'658	17'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		15'823'559	17'659'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		1'364'708	219'453'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		2'517'058	2'581'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		932'782	823'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		426'084	717'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		663'519	981'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		36'146	433'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		184'881	2'235'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		173'214	1'322'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		70'810	107'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		141'754	1'239'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		13'429	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		4'874	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		50'290	75'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		8'579	75'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		11'631	89'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		25'472	43'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		169'356	174'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		3'966	6'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		46'045	7'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		978'689	1'094'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		12'325	151'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		62'478	55'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		25'967	30'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		4'567	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		13'519	14'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		5'620	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		110'818	129'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		2'763'620	2'888'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		1'024'291	919'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		1'414'962	230'801'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		41'409	485'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		725'559	1'108'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		150'047	1'350'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		17'154'921	19'785'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		201'962	2'449'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		465'819	802'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		79'614	122'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		186'508	1'452'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		17'459	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		8'601	9'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		76'859	88'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		7'964	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		3'334	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		9'572	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		11'407	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		11'364	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		3'257	29'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		420'255	477'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		5'065	63'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		37'361	6'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		10'217	18'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		22'183	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		17'491	27'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		4'609	36'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		52'487	55'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		17'759'007	20'238'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		2'793'042	2'918'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		1'029'561	923'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		1'439'915	238'271'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		457'779	804'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		737'225	1'137'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		193'583	2'398'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		41'761	506'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		210'492	1'639'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		79'999	123'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		9'784	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		20'000	17'933		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		5'000	4'795		EUR/CHF	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		142'756	1'274'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		17'237'870	19'013'000		CHF/USD	-95'108.12	-0.09	b)
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		2'641'432	2'743'000		CHF/EUR	-9'689.53	-0.01	b)
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		1'045'098	941'000		CHF/GBP	-2'112.99	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		1'478'907	241'410'000		CHF/JPY	-3'749.31	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		456'461	776'000		CHF/AUD	-639.17	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		731'198	1'084'000		CHF/CAD	-66.47	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		44'829	525'000		CHF/NOK	-191.02	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		135'397	1'168'000		CHF/HKD	-605.75	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		80'711	121'000		CHF/SGD	-221.11	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		192'160	2'293'000		CHF/SEK	-510.87	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		202'773	1'569'000		CHF/DKK	-657.36	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-113'551.70</b>	<b>-0.10</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	5'526.13	0.01
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	107'813'402.40	99.53
Derivative Finanzinstrumente	-113'551.70	-0.10
Sonstige Vermögenswerte	621'309.75	0.57
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>108'326'686.58</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-661'562.73	
Andere Verbindlichkeiten	-33'919.60	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>107'631'204.25</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);	107'813'402.40	99.53
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-113'551.70	-0.10
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

## OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

## Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59041192
CAD	1 = CHF	0.67662722
DKK	100 = CHF	12.98841400
EUR	1 = CHF	0.96854454
GBP	1 = CHF	1.11655914
HKD	100 = CHF	11.68051000
JPY	100 = CHF	0.61303400
NOK	100 = CHF	8.59705800
SEK	100 = CHF	8.42031600
SGD	1 = CHF	0.67023225
USD	1 = CHF	0.91480000



## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	24'431'568.24	22.699

## 5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.15	-	0.106	0.00 - 0.08	-	0.014
FA CHF	CHF	0.00 - 0.15	-	0.106	0.00 - 0.08	-	0.014
VT CHF	CHF	0.00 - 0.15	-	0.106	0.00 - 0.08	-	0.014

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

**Periode:** 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
DT CHF	0.380	1.200	0.330	0.050	4.000
FA CHF	1.000	1.500	0.900	0.100	4.000
VT CHF	0.380	1.200	0.330	0.050	4.000

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

## 8 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 9 TER

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

## 10 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 23.01.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
FA CHF	Nein	CHF	1.10000	0.38500	0.71500

## 11 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 23.01.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	1.939	0.678	1.261
VT CHF 34)	Nein	CHF	1.992	-	1.992

## 12 Fussnoten

- 1) Der Bewertungs-Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 der Rechnungseinheit gerundet.
- 2) Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Käufe / Gratistitel / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock-/ Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs-/Optionsrechten / Sacheinlagen.
- 3) Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Verkäufe / Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs-/Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.
- 7) Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.
- 8) Kursangabe der britischen Titel in Pence.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

## 13 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4.
  - a) Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
  - b) Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
5. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 0.01 der Rechnungseinheit bzw., falls eine Anteilsklasse eine andere Währung als die Rechnungseinheit als Referenzwährung aufweist, der Referenzwährung gerundet.
6. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Klasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche

Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;

- c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Klasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des Teilvermögens, getätigt wurden.

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds

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

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 20 Passiv

Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 45 Passiv

Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 75 Passiv

Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 95 Passiv

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

Der Anlegerkreis bei der bestehenden Anteilsklasse VT CHF soll im Fondsvertrag unter § 6 Ziff. 4 erweitert werden. Bis anhin ist diese Anteilsklasse den folgenden Institutionen der beruflichen Vorsorge (2. Säule) und der gebundenen individuellen Vorsorge 3a vorbehalten: Freizügigkeitsstiftungen gemäss dem Bundesgesetz über die Freizügigkeit in der beruflichen Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (Freizügigkeitsgesetz, FZG) und Vorsorgeeinrichtungen/-formen der Säule 3a gemäss Verordnung über die steuerliche Abzugsberechtigung für Beiträge an anerkannte Vorsorgeformen (BVV 3). Neu soll diese Anteilsklasse ebenfalls Einrichtungen mit dem Zweck der Durchführung der ausserobligatorischen beruflichen Vorsorge gemäss Art. 1e der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) zur Verfügung stehen.

Zudem werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur (insbesondere Anpassungen in Zusammenhang mit dem Finanzdienstleistungsgesetz (FIDLEG) bzw. dem Finanzinstitutsgesetz (FINIG)) vorgenommen.

\*\*\*

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 umschriebenen 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, der Jahresbericht sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 12. Mai 2023

### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### **Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds**

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

mit den Teilvermögen

### **Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 20 Passiv**

(neu: Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 25 Passiv)

### **Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 45 Passiv**

### **Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 75 Passiv**

### **Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 95 Passiv**

(nachfolgend die "Teilvermögen")

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

Gegenstand der geplanten Anpassungen des Fondsvertrages ist die Änderung der Bezeichnung eines Teilvermögens (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 1 dieser Veröffentlichung).

Überdies soll die Anlagepolitik bei einem Teilvermögen angepasst werden (siehe dazu die Ausführungen unter Ziff. 2 dieser Veröffentlichung).

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

## **1 Umbenennung des Teilvermögens Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 20 Passiv**

Die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens wird wie folgt geändert:

Aktuelle Bezeichnung	Neue Bezeichnung
Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 20 Passiv	Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 25 Passiv

Im gesamten Fondsvertrag wird die Bezeichnung des oben genannten Teilvermögens angepasst (vgl. die Anpassungen in § 1 Ziff. 1, im Titel von § 8A und § 20 Ziff. 1 des Fondsvertrages)

## **2 Änderung in der Anlagepolitik des Teilvermögens Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 20 Passiv**

Die Anlagepolitik des oben genannten Teilvermögens erfährt infolge der neuen Bezeichnung Änderungen in den Anlagebestimmungen.

Gemäss der bestehenden Bestimmung in Ziff. 1 von § 8A des Fondsvertrages soll der Anteil der direkten und indirekten Anlagen in Beteiligungswertpapiere und Beteiligungswertrechte im langfristigen Durchschnitt 20% des Vermögens des Teilvermögens ausmachen. Neu soll diese Quote 25% betragen.

Zudem gilt bei der Anlage des Vermögens des Teilvermögens für direkte und indirekte Anlagen in Beteiligungswertpapiere und Beteiligungswertrechte auf konsolidierter Basis neu eine Maximallimite von 30%. Diese Quote belief sich bisher auf 25% (vgl. die Anpassung in § 8A Ziff. 2 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 Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anleger und Anlegerinnen 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, die Jahres- und Halbjahresberichte der Teilvermögen, das Basisinformationsblatt der Anteilklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 12. September 2023

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich