

SWISSCANTO (CH) VORSORGE FONDS 75 PASSIV

Jahresbericht per 30.09.2024

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	35369084	CHF
FA CHF	35369079	CHF
VT CHF	35369090	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 27. Januar 2025

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Vorsorge Fonds 25 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 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigefügten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag 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 Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilagen

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. September 2024, den Erfolgsrechnungen für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG)

Inhaltsverzeichnis

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

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		134'969'688.80	107'631'204.25	72'549'735.87	64'130'863.00
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		10'888'970.65	2'348'187.47	1'746'303.19	1'027'190.37
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		73'500.149	18'222.396	14'574.396	7'213.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		148.15	128.86	119.82	142.41
Thesaurierung je Anteil		1.92	1.93	1.80	1.40
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.42 %	0.42 %	0.42 %	0.42 %
Klasse FA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'234'019.72	2'010'658.73	1'671'175.79	1'859'734.96
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		23'440.766	16'589.217	14'636.978	13'667.752
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		137.97	121.20	114.17	136.07
Ausschüttung je Anteil		1.00	1.10	1.45	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.04 %	1.04 %	1.04 %	1.04 %
Klasse VT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		120'846'698.43	103'272'358.05	69'132'256.89	61'243'937.67
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		790'074.252	780'190.256	564'406.227	422'166.385
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		152.96	132.37	122.49	145.07
Thesaurierung je Anteil		1.98	1.99	1.84	1.41
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.42 %	0.42 %	0.42 %	0.42 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	15.56 %	7.42 %	-15.64 %	16.06 %
Klasse FA CHF	14.84 %	6.75 %	-16.16 %	15.35 %
Klasse VT CHF	15.55 %	7.42 %	-15.64 %	16.06 %

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	48'324.37	5'526.13
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	134'229'295.29	107'813'402.40
Derivative Finanzinstrumente	-24'590.53	-113'551.70
Sonstige Vermögenswerte	760'704.48	621'309.75
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	135'013'733.61	108'326'686.58
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-661'562.73
Andere Verbindlichkeiten	-44'044.81	-33'919.60
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	134'969'688.80	107'631'204.25

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		18'222.396	14'574.396
Ausgegebene Anteile		62'804.753	4'336.000
Zurückgenommene Anteile		-7'527.000	-688.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		73'500.149	18'222.396
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		16'589.217	14'636.978
Ausgegebene Anteile		9'110.125	2'119.309
Zurückgenommene Anteile		-2'258.576	-167.070
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		23'440.766	16'589.217
Klasse VT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		780'190.256	564'406.227
Ausgegebene Anteile		152'242.494	272'425.578
Zurückgenommene Anteile		-142'358.498	-56'641.549
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		790'074.252	780'190.256

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		107'631'204.25	72'549'735.87
Ausbezahlte Ausschüttung		-23'786.14	-21'515.07
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-14'423.09	-9'677.51
Saldo aus dem Anteilverkehr		10'099'293.97	29'057'434.07
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		17'277'399.81	6'055'226.89
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		134'969'688.80	107'631'204.25

Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		224.83	41.62
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-211.09	-0.22
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		2'173'216.57	1'775'170.31
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		109'382.64	234'793.00
Total Ertrag		2'282'612.95	2'010'004.71
Aufwand			
Passivzinsen		-729.79	-2'219.56
Reglementarische Vergütungen		-476'233.16	-360'819.02
Sonstige Aufwendungen		-526.40	-984.10
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-68'737.82	-38'267.81
Total Aufwand		-546'227.17	-402'290.49
Nettoertrag / Verlust		1'736'385.78	1'607'714.22
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-185'860.88	-35'005.89
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		46'163.37	49'271.79
Realisierter Erfolg		1'596'688.27	1'621'980.12
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		15'680'711.54	4'433'246.77
Gesamterfolg		17'277'399.81	6'055'226.89

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag	141'595.24	35'349.23
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	141'595.24	35'349.23
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	49'558.33	12'372.23
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	92'036.91	22'977.00
Total	141'595.24	35'349.23
Klasse FA CHF	30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag	23'438.05	17'911.10
Vortrag des Vorjahres	296.38	633.42
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	23'734.43	18'544.52
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	23'440.77	18'248.14
Vortrag auf neue Rechnung	293.66	296.38
Total	23'734.43	18'544.52
Klasse VT CHF	30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag	1'571'352.49	1'554'453.89
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	1'571'352.49	1'554'453.89
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'571'352.49	1'554'453.89
Total	1'571'352.49	1'554'453.89

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							134'229'295.29	99.42	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							134'229'295.29	99.42	
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	6'191	890	749	6'332 CAD	224.06	885'925.14	0.66	a)
CAD							885'925.14	0.66	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	12'374	1'589	1'643	12'320 CHF	162.82	2'005'985.42	1.49	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	5'995	846	895	5'946 CHF	139.47	829'302.28	0.61	a)
CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	35'382	7'573	2'869	40'085 CHF	114.49	4'589'401.74	3.40	a)
CH0117045127	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT	20'950	4'579	1'506	24'022 CHF	109.13	2'621'475.84	1.94	a)
CH0117045317	SWC (CH) IBF WORLD EX CHF GOVT. (I) NTH1 CHF	17'032	4'031	776	20'287 CHF	96.65	1'960'622.70	1.45	a)
CH0117048352	SWC (CH) INDEX BF WLD EX JPY/CHF INFL.-L. NTH1 CHF	19'988	5'224	994	24'218 CHF	108.36	2'624'365.39	1.94	a)
CH0117052453	SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF	1'149	195	60	1'284 CHF	105.67	135'666.86	0.10	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	35'237	7'382	5'135	37'485 CHF	179.47	6'727'501.07	4.98	a)
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	97'002	40'994	9'347	128'649 CHF	47.94	6'167'566.26	4.57	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	40'599	9'425	4'199	45'825 CHF	324.77	14'882'458.88	11.02	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	112'733	29'341	18'019	124'055 CHF	171.46	21'270'977.17	15.75	a)
CH0324760229	SWC (CH) INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH NT CHF	75'975	19'608	12'870	82'713 CHF	162.73	13'459'998.03	9.97	a)
CH0398970274	SWC (CH) IX BF EMMA HARD CURRENCY NTH1 CHF	6'836	1'497	482	7'852 CHF	85.19	668'893.17	0.50	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	24'569	5'607	6'521	23'654 CHF	171.22	4'050'186.31	3.00	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	98'743	26'819	12'837	112'725 CHF	98.83	11'140'082.34	8.25	a)
CH0595708501	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NTH1 CHF	0	8'971	34	8'937 CHF	89.84	802'917.82	0.59	a)
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	11'472	2'468	477	13'462 CHF	98.95	1'332'119.01	0.99	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	16	2	2	15 CHF	129'849.19	2'008'767.02	1.49	a)
CH1325827249	SWC (CH) IBF CORP. USD RESPONSIBLE NTH1 CHF	0	16'795	165	16'631 CHF	103.27	1'717'466.74	1.27	a)
CHF							98'995'754.05	73.32	
CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	5'959	686	6'645	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
EUR							0.00	0.00	
CH0117044807	SWC (CH) INDEX EF JAPAN NT	4'132	511	549	4'094 JPY	33'649.74	812'460.77	0.60	a)
CH1224025580	SWC (CH) IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	10	1	1	10 JPY	14'110'195.09	811'483.95	0.60	a)
JPY							1'623'944.72	1.20	
CH0117044690	SWC (CH) INDEX EF USA NT USD	23'797	3'364	2'975	24'186 USD	506.86	10'341'109.62	7.66	a)
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	12'550	1'208	13'758	0 USD	0.00	0.00	0.00	
CH0140549228	SWC (CH) INDEX EF MSCI@ WORLD EX SWITZERLAND NT USD	41'631	6'346	5'774	42'203 USD	338.00	12'032'901.83	8.91	a)
CH1224024922	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE ST USD	79	11	10	80 USD	153'431.77	10'349'659.93	7.67	a)
USD							32'723'671.38	24.24	
Derivative Finanzinstrumente							-24'590.53	-0.02	
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF	Verfall 02.11.2023	17'237'870	19'013'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall 02.11.2023	2'641'432	2'743'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF	Verfall 02.11.2023	1'045'098	941'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF	Verfall 02.11.2023	1'478'907	241'410'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF	Verfall 02.11.2023	456'461	776'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF	Verfall 02.11.2023	731'198	1'084'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF	Verfall 02.11.2023	44'829	525'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF	Verfall 02.11.2023	135'397	1'168'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF	Verfall 02.11.2023	80'711	121'000		CHF/SGD	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.
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		192'160	2'293'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		202'773	1'569'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		6'743	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		3'329	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		57'862	63'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		8'249	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		60'162	66'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'324	5'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		8'654	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		3'334	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		4'502	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		14'385	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		7'165	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		3'788	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		4'788	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		9'919	11'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		16'652'400	18'535'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		2'587'907	2'706'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		1'004'667	919'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		1'392'517	231'891'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		436'164	762'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		689'756	1'061'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		78'380	119'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		136'649	1'190'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		200'581	1'565'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		42'095	522'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		181'798	2'247'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		35'238	39'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		4'825	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		3'842	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		47'000	52'250	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		138'000	133'094	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		48'000	27'869	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		7'000	4'608	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		128'000	10'803	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		60'000	38'882	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.12.2023		75'000	8'482	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		88'000	11'385	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		12'500'000	73'759	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		1'070'000	943'037	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		7'924	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		11'413	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		39'359	45'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		3'475	6'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		17'032'569	19'576'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		993'036	899'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		2'658'391	2'788'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		432'806	750'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		699'899	1'093'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		181'003	2'162'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		201'624	1'576'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		41'255	506'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		129'266	1'160'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		73'811	113'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		51'389	59'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		5'660	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		8'714	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		13'935	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		3'775	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		35'839	41'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		15'595	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		3'715	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		35'121	42'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		1'392'584	234'178'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		4'760	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		4'761	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		4'749	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		17'610'328	21'019'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		2'716'759	2'926'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		1'005'150	941'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		1'416'637	238'001'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		76'412	120'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		41'549	505'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		199'498	2'375'000	CHF/SEK		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		473'876	827'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		127'947	1'192'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		205'338	1'648'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		743'559	1'174'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		11'900	14'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		9'663	9'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		22'272	24'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		26'023	28'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		9'412	1'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		5'714	9'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		133'904	158'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		7'535	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		30'427	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		3'234	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		11'146	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		29'759	35'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		13'936	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		5'853	1'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		3'246	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		68'813	81'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		11'190	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		23'000	21'493		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		231'000	198'355		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		8'000	8'693		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		9'000	5'102		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		12'000	7'645		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		2'700'000	15'815		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		18'557'218	21'588'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		2'786'105	2'991'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		1'038'662	952'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		1'491'412	254'775'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		757'119	1'181'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		467'998	826'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		194'413	2'350'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		217'741	1'742'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		40'733	496'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		75'831	118'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.03.2024		124'850	1'134'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		4'667	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		9'494	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		17'000	14'777		USD/CHF	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		7'469	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		13'022	15'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		19'329'267	22'078'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		2'915'576	3'067'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		1'060'242	956'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		480'103	842'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		1'586'110	270'185'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		76'924	118'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		764'847	1'186'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		237'611	1'863'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.04.2024		39'357	476'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		209'336	2'468'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.04.2024		125'832	1'124'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		3'529	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		3'828	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		17'242	18'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		33'437	38'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		23'658	27'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		3'569	600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		57'830	66'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2024		1'669'326	278'454'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		2'340'771	2'399'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		1'120'551	984'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		804'200	1'211'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		494'761	843'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		81'076	121'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		254'538	1'945'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2024		121'239	1'049'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		18'777'431	20'793'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		217'772	2'576'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2024		41'035	492'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		3'918	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		32'448	36'000		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.
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		2'317'404	2'377'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		1'146'759	1'006'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		18'538'598	20'381'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		1'560'417	267'840'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		41'770	506'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		807'349	1'215'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		82'265	123'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.06.2024		123'332	1'060'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		487'100	820'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		209'367	2'518'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		251'088	1'920'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		8'000	7'285		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		30'663	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		4'628	7'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		65'864	73'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.06.2024		13'000	7'787		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.06.2024		19'000	12'572		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		28'000	27'377		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.06.2024		23'000	3'015		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.06.2024		12'000	13'633		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		284'000	256'812		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.06.2024		2'600'000	15'123		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		81'175	14'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		12'475	95'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.06.2024		6'371	55'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		10'539	126'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		41'754	63'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		4'017	6'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		967'498	1'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		115'592	118'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		59'197	52'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		24'573	41'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		19'795'244	21'944'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		1'180'478	1'030'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		1'635'538	283'626'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		2'430'823	2'488'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		518'914	867'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		42'857	500'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		231'375	2'713'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		269'666	2'058'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		80'822	121'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		62'657	70'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		11'000	9'821		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.07.2024		4'000	3'803		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		42'000	37'339		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		40'000	35'757		USD/CHF	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.07.2024		132'203	1'145'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		832'380	1'261'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		1'163'948	1'028'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		1'613'248	288'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		20'307'595	22'690'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		2'328'855	2'427'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.08.2024		120'294	1'048'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.08.2024		79'956	121'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.08.2024		280'701	2'181'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.08.2024		41'229	491'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		224'715	2'668'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		7'087	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		518'132	872'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		815'296	1'248'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		4'631	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		19'963'494	22'729'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		2'289'506	2'406'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		1'176'416	1'043'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		832'455	1'310'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		518'742	907'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		1'650'886	283'690'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		40'591	504'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		221'773	2'710'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		257'332	2'016'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		118'735	1'055'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.09.2024		83'382	127'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		76'208	89'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		7'492	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		7'036	1'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		3'291	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		34'673	40'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		5'720	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		7'630	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		31'161	37'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		19'997'311	23'699'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		2'336'968	2'494'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		1'173'949	1'054'000		CHF/GBP	0.00	0.00		
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		851'431	1'358'000		CHF/CAD	0.00	0.00		
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		534'886	930'000		CHF/AUD	0.00	0.00		
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		231'870	2'803'000		CHF/SEK	0.00	0.00		
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		41'359	514'000		CHF/NOK	0.00	0.00		
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		261'510	2'080'000		CHF/DKK	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		1'647'481	281'640'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		81'276	125'000		CHF/SGD	0.00	0.00		
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		6'557	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		57'608	68'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		3'505	600'000		CHF/JPY	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		32'983	39'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	HKD/CHF Verfall 03.10.2024		119'968	1'107'000		CHF/HKD	0.00	0.00		
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		1'180'382	1'050'400		CHF/GBP	-3'493.27	0.00	b)	
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		2'412'480	2'571'000		CHF/EUR	-2'131.43	0.00	b)	
	USD/CHF Verfall 04.11.2024		20'567'341	24'505'000		CHF/USD	-24'837.93	-0.02	b)	
	SEK/CHF Verfall 04.11.2024		243'635	2'927'000		CHF/SEK	592.39	0.00	b)	
	DKK/CHF Verfall 04.11.2024		251'446	1'997'000		CHF/DKK	-231.00	0.00	b)	
	NOK/CHF Verfall 04.11.2024		40'259	503'900		CHF/NOK	42.50	0.00	b)	
	AUD/CHF Verfall 04.11.2024		553'355	950'500		CHF/AUD	-1'043.47	0.00	b)	
	CAD/CHF Verfall 04.11.2024		882'008	1'418'800		CHF/CAD	-1'245.45	0.00	b)	
	HKD/CHF Verfall 04.11.2024		132'775	1'228'500		CHF/HKD	-187.94	0.00	b)	
	SGD/CHF Verfall 04.11.2024		88'354	134'600		CHF/SGD	-15.23	0.00	b)	
	JPY/CHF Verfall 05.11.2024		1'687'848	284'610'000		CHF/JPY	7'960.30	0.01	b)	
Devisentermingeschäfte								-24'590.53	-0.02	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	48'324.37	0.04
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	134'229'295.29	99.42
Derivative Finanzinstrumente	-24'590.53	-0.02
Sonstige Vermögenswerte	760'704.48	0.56
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	135'013'733.61	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-44'044.81	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	134'969'688.80	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen regelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden: bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	134'229'295.29	99.42
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-24'590.53	-0.02
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

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

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % (28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	28'158'870.33	20.863

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.14	-	0.080	0.00 - 0.08	-	0.024
FA CHF	CHF	0.00 - 0.14	-	0.080	0.00 - 0.08	-	0.024
VT CHF	CHF	0.00 - 0.14	-	0.080	0.00 - 0.08	-	0.024

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. 2 geregelt.

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2023 - 30.09.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Eff
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 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
FA CHF	Nein	CHF	1.00000	0.35000	0.65000

11 Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024

Ex-Datum: 22.01.2025

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 27.01.2025

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
DT CHF	Nein	CHF	1.926	0.674	1.252
VT CHF 34)	Nein	CHF	1.988	-	1.988

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.