

SWISSCANTO (CH) VORSORGE FONDS 95 PASSIV

Jahresbericht per 30.09.2023

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

Klasse	Valor	Währung
DT CHF	49647089	CHF
FA CHF	49646831	CHF
VT CHF	49647093	CHF

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter 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 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

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	12
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
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		32'095'187.25	21'376'425.61	16'870'241.53	9'916'098.79
Klasse DT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		773'668.12	384'285.09	599'357.53	5'256'165.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		6'768.000	3'717.997	4'746.018	51'682.352
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		114.31	103.36	126.29	101.70
Thesaurierung je Anteil		1.55	1.55	1.20	1.67
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse FA CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'522'050.37	1'207'927.45	1'348'295.03	171'120.18
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'745.441	11'903.377	10'843.936	1'692.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		110.73	101.48	124.34	101.13
Ausschüttung je Anteil		0.85	1.35	-	1.00
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.02 %	1.02 %	1.02 %	1.02 %
Klasse VT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		29'799'468.76	19'784'213.07	14'922'588.97	4'488'812.73
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		257'279.166	189'806.777	117'571.612	44'142.420
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		115.83	104.23	126.92	101.69
Thesaurierung je Anteil		1.58	1.56	1.21	1.66
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %

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

Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse DT CHF (Lancierung 05.11.2019)	11.12 %	-17.90 %	19.04 %	8.62 %
Klasse FA CHF (Lancierung 05.11.2019)	10.43 %	-18.41 %	18.28 %	7.96 %
Klasse QT CHF (Lancierung 05.11.2019, Schliessung 02.09.2020)	-	-	-	1.87 %
Klasse VT CHF (Lancierung 05.11.2019)	11.13 %	-17.90 %	19.04 %	8.61 %

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	1'969.14	52'242.19
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	32'325'775.27	21'248'280.53
Derivative Finanzinstrumente	-55'023.58	-51'352.17
Sonstige Vermögenswerte	177'398.96	134'896.84
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	32'450'119.79	21'384'067.39
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-344'337.67	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-10'594.87	-7'641.78
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	32'095'187.25	21'376'425.61

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Klasse DT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'717.997	4'746.018
Ausgegebene Anteile		3'329.003	3'911.000
Zurückgenommene Anteile		-279.000	-4'939.021
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		6'768.000	3'717.997

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		11'903.377	10'843.936
Ausgegebene Anteile		3'307.068	4'601.377
Zurückgenommene Anteile		-1'465.004	-3'541.936
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'745.441	11'903.377

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Klasse VT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		189'806.777	117'571.612
Ausgegebene Anteile		82'784.838	88'897.631
Zurückgenommene Anteile		-15'312.449	-16'662.466
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		257'279.166	189'806.777

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		21'376'425.61	16'870'241.53
Ausbezahlte Ausschüttung		-17'369.61	0.00
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-3'037.69	-322.13
Saldo aus dem Anteilverkehr		8'296'608.15	8'923'650.09
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		2'442'560.79	-4'417'143.88
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		32'095'187.25	21'376'425.61

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		9.35	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-0.11	-62.80
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		506'853.01	385'419.50
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		52'344.70	22'270.30
Total Ertrag		559'206.95	407'627.00
Aufwand			
Passivzinsen		-718.90	-707.95
Reglementarische Vergütungen		-114'341.27	-87'921.58
Sonstige Aufwendungen		-275.55	-494.10
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-15'350.59	-5'767.17
Total Aufwand		-130'686.31	-94'890.80
Nettoertrag / Verlust		428'520.64	312'736.20
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		106'160.59	36'497.05
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		10'544.20	11'058.61
Realisierter Erfolg		545'225.43	360'291.86
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		1'897'335.36	-4'777'435.74
Gesamterfolg		2'442'560.79	-4'417'143.88

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	10'553.73	5'768.48
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10'553.73	5'768.48
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	3'693.81	2'018.97
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'859.92	3'749.51
Total	10'553.73	5'768.48
Klasse FA CHF		
	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	11'419.16	9'965.58
Vortrag des Vorjahres	292.11	6'396.09
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	11'711.27	16'361.67
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	11'683.62	16'069.56
Vortrag auf neue Rechnung	27.65	292.11
Total	11'711.27	16'361.67
Klasse VT CHF		
	30.09.2023	30.09.2022
Nettoertrag	406'547.75	297'002.14
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	406'547.75	297'002.14
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	406'547.75	297'002.14
Total	406'547.75	297'002.14

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.
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							32'325'775.27	99.62	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							32'325'775.27	99.62	
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	2'108	751	0	2'859 CAD	178.40	345'105.70	1.06	a)
CAD							345'105.70	1.06	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	8'525	1'166	1'966	7'725 CHF	141.36	1'092'044.00	3.37	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	2'046	737	0	2'783 CHF	119.79	333'347.41	1.03	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	3'657	1'811	258	5'210 CHF	156.48	815'222.28	2.51	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	10'589	4'953	1'084	14'458 CHF	291.54	4'215'041.54	12.99	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	18'352	8'675	1'770	25'257 CHF	152.93	3'862'550.43	11.90	a)
CH0324760229	SWC (CH) INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH NT CHF	15'629	7'950	730	22'850 CHF	142.06	3'246'089.44	10.00	a)
CH0451461757	SWC (CH) IX EF WORLD (EX CH) RESPONSIBLE NT CHF	12'414	2'182	14'596	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0451461963	SWC (CH) IX EF SWITZERLAND TOTAL RESP. NT CHF	8'559	3'986	765	11'779 CHF	136.78	1'611'183.13	4.97	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	4'548	1'661	120	6'089 CHF	127.43	775'952.56	2.39	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	24'540	14'229	1'722	37'047 CHF	87.87	3'255'200.71	10.03	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	0	5	0	5 CHF	112'187.40	519'091.12	1.60	a)
CH1252030114	SWC (CH) INDEX EF MSCI@ WORLD EX SWITZERLAND ST CHF	0	24	1	23 CHF	103'217.78	2'423'656.77	7.47	a)
CHF							22'149'379.39	68.26	
CH0117044807	SWC (CH) INDEX EF JAPAN NT	2'789	392	569	2'613 JPY	29'048.60	465'259.76	1.43	a)
CH1224025580	SWC (CH) IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	0	3	0	3 JPY	12'214'254.18	210'555.62	0.65	a)
JPY							675'815.38	2.08	
CH0117044690	SWC (CH) INDEX EF USA NT USD	16'092	2'244	4'041	14'295 USD	374.77	4'901'009.78	15.10	a)
CH0140549228	SWC (CH) INDEX EF MSCI@ WORLD EX SWITZERLAND NT USD	5'059	1'891	44	6'906 USD	255.78	1'615'940.93	4.98	a)
CH1224024922	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE ST USD	0	25	0	25 USD	113'161.62	2'638'524.09	8.13	a)
USD							9'155'474.80	28.21	
Derivative Finanzinstrumente							-55'023.58	-0.17	
Devisentermingeschäfte									
	USD/CHF	Verfall 02.11.2022	5'841'461	5'993'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall 02.11.2022	660'707	689'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	338'522	311'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF	Verfall 02.11.2022	492'246	72'680'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF	Verfall 02.11.2022	174'203	275'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF	Verfall 02.11.2022	286'988	403'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF	Verfall 02.11.2022	73'433	837'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF	Verfall 02.11.2022	57'638	447'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF	Verfall 02.11.2022	17'117	187'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF	Verfall 02.11.2022	63'072	507'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF	Verfall 02.11.2022	29'312	43'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall 02.11.2022	6'827	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF	Verfall 02.11.2022	2'889	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	3'381	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF	Verfall 02.11.2022	3'407	500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF	Verfall 02.11.2022	38'099	38'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF	Verfall 02.11.2022	1'987	2'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF	Verfall 02.12.2022	185'898	291'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF	Verfall 02.12.2022	310'561	425'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF	Verfall 02.12.2022	63'764	479'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF	Verfall 02.12.2022	6'153'381	6'175'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF	Verfall 02.12.2022	81'673	899'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF	Verfall 02.12.2022	30'333	43'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF	Verfall 02.12.2022	740'282	747'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF	Verfall 02.12.2022	365'675	317'000		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.
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		58'561	461'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		513'668	76'080'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.12.2022		19'118	199'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		2'050	300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		56'959	59'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		3'384	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		7'873	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		19'825	21'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		27'782	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		1'963	2'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		27'600	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		2'938	3'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		2'825	3'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		115'438	122'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		40'379	41'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		10'196	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		6'658	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		6'371'669	6'724'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		830'455	844'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		393'110	346'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		207'554	326'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		324'794	465'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		87'279	970'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2023		19'919	210'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		70'869	536'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		65'172	537'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		33'860	49'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		16'740	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		9'335	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		5'541	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		1'964	2'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		12'958	14'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		3'956	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		38'143	41'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		6'520	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		31'420	34'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		1'969	2'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		42'542	46'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		7'862	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		3'361	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		2'717	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		4'646	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		43'603	47'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		7'884	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		19'477	21'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		2'730	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		3'349	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		1'880	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		5'540	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		575'510	83'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		2'047	300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		4'212	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		10'446	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		314'114	462'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		207'172	331'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		34'975	51'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		87'163	987'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2023		20'171	216'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		75'759	641'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		591'225	84'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		6'222'667	6'759'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		400'018	360'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		837'125	851'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		76'862	581'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		22'243	24'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		1'661	14'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		4'451	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		12'799	13'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		5'585	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		3'426	5'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		14'963	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		13'964	15'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		32'986	36'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		23'023	25'000	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.
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		3'358	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		2'741	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		2'537	4'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		7'915	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		3'208	5'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		2'105	300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		15'015	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		1'597	18'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		6'762	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		112'405	121'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		4'150	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		3'709	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		2'076	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		2'006	2'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		10'020	1'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		92'466	100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		2'265	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		51'293	56'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		2'142	300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'944	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		83'019	90'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		9'089	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		15'056	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		11'354	1'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		1'964	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		3'461	5'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		5'681	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		4'002	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		23'993	26'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		7'063'042	7'642'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		993'447	992'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		450'113	395'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		652'195	91'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		361'392	525'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		243'005	374'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.03.2023		20'912	226'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		83'351	619'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		100'484	1'131'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		39'340	56'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.03.2023		85'342	723'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		14'585	16'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		11'795	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		1'988	2'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		9'396	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		23'424	25'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		103'405	1'147'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		7'024'535	7'513'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		454'828	404'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		994'056	1'001'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		630'875	91'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		79'026	662'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		87'790	658'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		353'452	514'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		230'410	367'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		38'115	55'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		21'085	233'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		4'825	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		1'995	2'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		16'890	18'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		2'069	3'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		1'896	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		2'745	400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		3'977	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		31'601	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		85'502	94'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		19'139	21'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		22'128	24'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		5'569	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		16'532	17'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		7'767	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		10'989	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		18'405	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		37'676	41'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		2'989	3'000		CHF/EUR	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 04.04.2023		4'815	700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		93'440	700'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		38'444	56'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2023		79'406	683'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		344'596	512'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		220'952	362'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		7'225'515	7'929'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		20'179	230'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		1'030'113	1'036'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		100'767	1'143'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		452'758	401'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		8'189	9'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		5'428	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		3'944	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		43'300	48'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		15'403	23'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		14'325	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		6'866	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		2'220	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		19'516	22'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		23'088	26'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		6'912	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		3'953	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		22'417	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		657'018	95'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		7'611	1'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		9'402	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		7'361'784	8'258'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		1'076'988	1'096'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		477'665	429'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		666'297	101'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		366'070	560'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		77'793	684'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		106'457	1'228'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		97'550	740'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		221'885	377'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		20'584	246'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		2'653	3'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		73'670	83'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		3'915	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		1'981	300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		28'451	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		3'994	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		2'926	3'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		12'572	14'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		9'773	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		3'890	4'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		22'000	19'762	USD/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		38'034	57'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		7'816'289	8'616'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		1'072'700	1'105'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		477'272	425'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		717'580	109'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		366'762	551'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		224'243	381'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		104'293	1'254'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		19'790	245'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		100'606	772'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		75'585	652'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		38'874	58'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		54'888	61'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		35'000	31'366	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		5'384	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		6'865	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		3'423	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		2'971	26'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		8'390	14'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		44'766	50'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		8'121'906	9'064'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		1'078'600	1'106'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		731'939	117'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		473'758	418'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		234'733	395'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		370'651	548'000	CHF/CAD		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.
NOK/CHF	Verfall 03.08.2023		20'202	242'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.08.2023		103'484	1'251'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.08.2023		96'958	740'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.08.2023		39'045	59'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 03.08.2023		78'028	682'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.08.2023		5'849	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 03.08.2023		6'016	967'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.08.2023		5'062	7'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.08.2023		44'762	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.08.2023		6'262	7'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.08.2023		9'734	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.08.2023		3'417	3'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.08.2023		52'388	59'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.08.2023		16'841	19'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.08.2023		20'279	21'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.08.2023		8'991	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.08.2023		181'261	211'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.08.2023		7'830	12'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.08.2023		33'000	28'264		USD/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.08.2023		8'000	6'923		USD/CHF	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.09.2023		1'144'491	1'196'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.09.2023		501'557	450'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.09.2023		754'482	123'067'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 05.09.2023		22'370	262'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.09.2023		389'301	594'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.09.2023		80'247	722'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		8'544'078	9'854'000		CHF/USD	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.09.2023		109'104	1'323'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.09.2023		249'173	429'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.09.2023		42'417	65'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.09.2023		100'704	784'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		33'189	38'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		2'623	3'000		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.09.2023		3'053	500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		6'115	7'000		CHF/USD	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.09.2023		10'256	1'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 05.09.2023		1'681	15'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.09.2023		7'832	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.09.2023		5'100	9'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.09.2023		18'194	19'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.09.2023		8'438	13'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.09.2023		1'695	21'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		117'548	134'000		CHF/USD	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 05.09.2023		1'799	14'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 05.09.2023		3'000	3'357		GBP/CHF	0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 05.09.2023		10'000	9'552		EUR/CHF	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 05.09.2023		82'000	71'915		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		48'367	55'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		18'403	21'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		8'710'144	9'926'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.10.2023		1'128'512	1'179'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.10.2023		491'914	441'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 03.10.2023		755'198	124'967'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.10.2023		243'124	427'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.10.2023		391'955	604'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.10.2023		102'120	1'265'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 03.10.2023		22'036	267'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.10.2023		111'089	865'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.10.2023		42'276	65'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		7'052	8'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		19'507	22'000		CHF/USD	0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.10.2023		2'852	3'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.10.2023		75'860	677'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		8'449'848	9'320'000		CHF/USD	-46'621.14	-0.14	b)
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		1'060'232	1'101'000		CHF/EUR	-3'889.24	-0.01	b)
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		504'224	454'000		CHF/GBP	-1'019.45	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		775'365	126'567'000		CHF/JPY	-1'965.70	-0.01	b)
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023		240'583	409'000		CHF/AUD	-336.88	0.00	b)
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023		385'498	571'500		CHF/CAD	-35.04	0.00	b)
NOK/CHF	Verfall 02.11.2023		23'738	278'000		CHF/NOK	-101.15	0.00	b)
HKD/CHF	Verfall 02.11.2023		71'408	616'000		CHF/HKD	-319.48	0.00	b)
SGD/CHF	Verfall 02.11.2023		42'023	63'000		CHF/SGD	-115.13	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 02.11.2023		102'072	1'218'000		CHF/SEK	-271.37	0.00	b)
DKK/CHF	Verfall 02.11.2023		107'654	833'000		CHF/DKK	-349.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte							-55'023.58	-0.17	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	1'969.14	0.01
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	32'325'775.27	99.62
Derivative Finanzinstrumente	-55'023.58	-0.17
Sonstige Vermögenswerte	177'398.96	0.55
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	32'450'119.79	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-344'337.67	
Andere Verbindlichkeiten	-10'594.87	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	32'095'187.25	

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);	32'325'775.27	99.62
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-55'023.58	-0.17
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	11'852'120.40	36.928

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 Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.085	0.00 - 0.09	-	0.021
FA CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.085	0.00 - 0.09	-	0.021
VT CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.085	0.00 - 0.09	-	0.021

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	0.85000	0.29750	0.55250

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	1.559	0.545	1.014
VT CHF 34)	Nein	CHF	1.580	-	1.580

12 Fussnoten

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

<u>Aktuelle Bezeichnung</u>	<u>Neue Bezeichnung</u>
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^{bis} 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