

SWISSCANTO (CH) VORSORGE FONDS 95 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	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, 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	13
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	13
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	14
9	TER	14
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2023 / 2024	15
11	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	15
12	Fussnoten	15
13	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2023	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020
	bis	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021
Konsolidiert	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		45'516'872.68	32'095'187.25	21'376'425.61	16'870'241.53
Klasse DT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'323'450.28	773'668.12	384'285.09	599'357.53
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		9'771.000	6'768.000	3'717.997	4'746.018
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		135.45	114.31	103.36	126.29
Thesaurierung je Anteil		1.92	1.55	1.55	1.20
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse FA CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		773'355.02	1'522'050.37	1'207'927.45	1'348'295.03
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'947.690	13'745.441	11'903.377	10'843.936
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		130.03	110.73	101.48	124.34
Ausschüttung je Anteil		1.10	0.85	1.35	-
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		1.02 %	1.02 %	1.02 %	1.02 %
Klasse VT CHF	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		43'420'067.38	29'799'468.76	19'784'213.07	14'922'588.97
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		314'943.683	257'279.166	189'806.777	117'571.612
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		137.87	115.83	104.23	126.92
Thesaurierung je Anteil		1.95	1.58	1.56	1.21
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %

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

Performance

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse DT CHF	19.04 %	10.27 %	-17.90 %	19.04 %
Klasse FA CHF	18.30 %	9.59 %	-18.41 %	18.28 %
Klasse VT CHF	19.03 %	10.26 %	-17.90 %	19.04 %

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	28'694.76	1'969.14
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	45'247'127.86	32'325'775.27
Derivative Finanzinstrumente	-14'725.56	-55'023.58
Sonstige Vermögenswerte	270'465.61	177'398.96
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	45'531'562.67	32'450'119.79
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-344'337.67
Andere Verbindlichkeiten	-14'689.99	-10'594.87
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	45'516'872.68	32'095'187.25

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		6'768.000	3'717.997
Ausgegebene Anteile		3'032.000	3'329.003
Zurückgenommene Anteile		-29.000	-279.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		9'771.000	6'768.000
Klasse FA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		13'745.441	11'903.377
Ausgegebene Anteile		1'655.751	3'307.068
Zurückgenommene Anteile		-9'453.502	-1'465.004
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'947.690	13'745.441
Klasse VT CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		257'279.166	189'806.777
Ausgegebene Anteile		98'233.216	82'784.838
Zurückgenommene Anteile		-40'568.699	-15'312.449
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		314'943.683	257'279.166

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		32'095'187.25	21'376'425.61
Ausbezahlte Ausschüttung		-10'613.47	-17'369.61
Thesaurierung; 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		-4'273.97	-3'037.69
Saldo aus dem Anteilverkehr		6'665'607.18	8'296'608.15
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		6'770'965.69	2'442'560.79
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		45'516'872.68	32'095'187.25

Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2023 30.09.2024	01.10.2022 30.09.2023
Konsolidiert			
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		23.41	9.35
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-32.97	-0.11
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		772'735.65	506'853.01
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		48'879.03	52'344.70
Total Ertrag		821'605.12	559'206.95
Aufwand			
Passivzinsen		-449.80	-718.90
Reglementarische Vergütungen		-156'184.83	-114'341.27
Sonstige Aufwendungen		-183.90	-275.55
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-23'859.23	-15'350.59
Total Aufwand		-180'677.76	-130'686.31
Nettoertrag / Verlust		640'927.36	428'520.64
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		194'747.89	106'160.59
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		14'052.13	10'544.20
Realisierter Erfolg		849'727.38	545'225.43
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		5'921'238.31	1'897'335.36
Gesamterfolg		6'770'965.69	2'442'560.79

Verwendung des Erfolges

Klasse DT CHF	30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag	18'766.40	10'553.73
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	18'766.40	10'553.73
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer	6'568.24	3'693.81
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	12'198.16	6'859.92
Total	18'766.40	10'553.73

Klasse FA CHF	30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag	6'526.27	11'419.16
Vortrag des Vorjahres	27.65	292.11
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6'553.92	11'711.27
Zur Ausschüttung an die Anleger vorgesehener Erfolg	6'542.46	11'683.62
Vortrag auf neue Rechnung	11.46	27.65
Total	6'553.92	11'711.27

Klasse VT CHF	30.09.2024	30.09.2023
Nettoertrag	615'634.69	406'547.75
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	615'634.69	406'547.75
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	615'634.69	406'547.75
Total	615'634.69	406'547.75

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- 30.09.2024 rung	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden							45'247'127.86	99.38	
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen							45'247'127.86	99.38	
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	2'859	623	171	3'311 CAD	224.06	463'169.52	1.02	a)
CAD							463'169.52	1.02	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	7'725	561	1'166	7'120 CHF	162.82	1'159'253.21	2.55	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	2'783	510	184	3'109 CHF	139.47	433'600.53	0.95	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	5'210	1'585	405	6'390 CHF	179.47	1'146'910.01	2.52	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	14'458	5'340	1'747	18'051 CHF	324.77	5'862'357.49	12.88	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	25'257	9'717	3'892	31'082 CHF	171.46	5'329'422.57	11.70	a)
CH0324760229	SWC (CH) INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH NT CHF	22'850	9'326	4'418	27'758 CHF	162.73	4'517'025.09	9.92	a)
CH0451461963	SWC (CH) IX EF SWITZERLAND TOTAL RESP. NT CHF	11'779	4'456	1'693	14'542 CHF	152.99	2'224'810.67	4.89	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	6'089	2'770	2'212	6'647 CHF	171.22	1'138'088.91	2.50	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	37'047	16'027	5'818	47'256 CHF	98.83	4'670'082.63	10.26	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	5	3	0	7 CHF	129'849.19	948'937.90	2.08	a)
CH1252030114	SWC (CH) INDEX EF MSCI@ WORLD EX SWITZERLAND ST CHF	23	6	2	27 CHF	125'957.54	3'392'666.42	7.45	a)
CHF							30'823'155.43	67.70	
CH0117044807	SWC (CH) INDEX EF JAPAN NT	2'613	174	430	2'356 JPY	33'649.74	467'609.97	1.03	a)
CH1224025580	SWC (CH) IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	3	2	0	5 JPY	14'110'195.09	382'109.75	0.84	a)
JPY							849'719.72	1.87	
CH0117044690	SWC (CH) INDEX EF USA NT USD	14'295	1'759	2'113	13'942 USD	506.86	5'960'997.76	13.09	a)
CH0140549228	SWC (CH) INDEX EF MSCI@ WORLD EX SWITZERLAND NT USD	6'906	1'519	472	7'953 USD	338.00	2'267'567.19	4.98	a)
CH1224024922	SWC (CH) IEF USA RESPONSIBLE ST USD	25	14	2	38 USD	153'431.77	4'882'518.24	10.72	a)
USD							13'111'083.19	28.80	

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.
Derivative Finanzinstrumente							-14'725.56	-0.03	
Devisentermingeschäfte									
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		8'449'848	9'320'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		1'060'232	1'101'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		504'224	454'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.11.2023		775'365	126'567'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.11.2023		240'583	409'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.11.2023		385'498	571'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.11.2023		23'738	278'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 02.11.2023		71'408	616'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.11.2023		42'023	63'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.11.2023		102'072	1'218'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.11.2023		107'654	833'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		26'635	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		11'916	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		11'761	13'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.11.2023		3'316	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.11.2023		7'645	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.11.2023		24'368	27'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 02.11.2023		60'000	54'108	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		8'092'159	9'007'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023		1'024'260	1'071'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.12.2023		481'016	440'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.12.2023		725'812	120'867'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.12.2023		227'813	398'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.12.2023		359'830	553'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.12.2023		40'836	62'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.12.2023		71'425	622'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.12.2023		105'994	827'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 04.12.2023		22'257	276'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.12.2023		96'037	1'187'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		4'518	5'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		233'466	260'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		5'404	6'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023		24'045	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		84'033	95'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		15'896	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		18'513	21'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		40'700	46'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.12.2023		4'410	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023		9'618	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.12.2023		10'654	1'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.12.2023		4'644	8'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.12.2023		9'719	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		264'375	300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023		38'573	40'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.12.2023		3'335	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.12.2023		20'650	3'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 04.12.2023		6'508	1'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		41'263	47'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.12.2023		5'786	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.12.2023		2'227	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.12.2023		6'122	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		8'947'841	10'284'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		507'012	459'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		1'139'447	1'195'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2024		242'372	420'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		391'572	611'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.01.2024		102'390	1'223'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.01.2024		113'989	891'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 04.01.2024		23'236	285'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.01.2024		72'433	650'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 04.01.2024		41'152	63'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		77'372	89'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2024		4'717	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		6'968	8'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		14'813	17'000	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		13'173	14'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2024		5'486	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		30'699	35'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2024		26'000	22'728	USD/CHF		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2024		60'681	71'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2024		5'761	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		6'501	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		779'415	131'067'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		15'635	2'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		9'416'360	11'239'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		1'188'466	1'280'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		521'268	488'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		815'259	136'967'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		44'574	70'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		23'778	289'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		114'659	1'365'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		276'189	482'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		74'600	695'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		117'994	947'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		433'532	684'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		22'100	26'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		105'089	124'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		10'588	1'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		31'600	34'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		3'116	25'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		3'074	37'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		13'993	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		14'835	16'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		6'460	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		83'583	99'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		2'549	3'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		35'000	30'054	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		26'000	22'640	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		173'506	201'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		13'097	14'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		10'285	16'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		12'263	2'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		5'467	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		10'219'880	11'889'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		1'257'520	1'350'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		557'517	511'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		880'810	150'467'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		452'284	705'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		275'926	487'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		115'821	1'400'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		129'745	1'038'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		24'226	295'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		44'342	69'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.03.2024		73'545	668'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		26'000	22'335	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		30'000	26'090	USD/CHF		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		7'614	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		3'339	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		4'621	8'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		6'466	1'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		131'848	150'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		31'727	36'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		5'718	6'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		2'233	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		1'500'000	8'765	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		79'000	69'529	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		10'766'887	12'298'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		1'296'657	1'364'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		558'956	504'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		288'518	506'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		138'893	1'089'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.04.2024		22'986	278'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		122'480	1'444'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.04.2024		75'678	676'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		919'707	156'667'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		45'633	70'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		460'133	713'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2024		108'000	95'065	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		4'489	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		10'541	11'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		61'342	70'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		4'798	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		21'905	25'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2024		956'601	159'567'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		1'379'679	1'414'000	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.
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		593'300	521'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2024		487'766	734'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2024		301'669	514'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2024		48'914	73'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2024		149'975	1'146'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2024		73'737	638'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		11'227'807	12'433'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2024		128'330	1'518'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2024		24'187	290'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		17'000	15'462	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.05.2024		5'000	4'847	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2024		29'000	26'401	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.05.2024		1'200'000	7'072	JPY/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		4'524	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2024		17'653	3'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		14'553	16'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		10'707	11'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.05.2024		13'564	2'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2024		3'406	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2024		9'762	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2024		50'219	55'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		1'366'849	1'402'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		610'997	536'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		10'916'134	12'001'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		910'401	156'267'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.06.2024		24'600	298'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.06.2024		477'432	718'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.06.2024		48'155	72'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.06.2024		72'952	627'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.06.2024		287'508	484'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.06.2024		123'558	1'486'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.06.2024		148'168	1'133'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.06.2024		2'000	1'949	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.06.2024		10'000	9'106	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		17'135	19'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		18'947	21'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		12'680	14'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		7'802	8'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.06.2024		3'397	3'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		57'939	64'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		5'244	900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		1'806	2'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.06.2024		1'746	300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.06.2024		79'420	87'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.06.2024		1'977	2'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		11'352'677	12'585'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		610'869	533'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		929'951	161'267'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		1'397'137	1'430'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.07.2024		24'600	287'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.07.2024		132'958	1'559'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		155'012	1'183'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.07.2024		46'756	70'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		299'259	500'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		109'710	123'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		17'795	20'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		16'112	18'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		6'281	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.07.2024		1'553	12'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		5'708	5'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		96'901	109'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		13'513	14'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.07.2024		35'000	31'133	USD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.07.2024		2'269	2'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.07.2024		1'792	3'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.07.2024		4'804	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.07.2024		1'676	300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.07.2024		17'040	19'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.07.2024		76'204	660'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		472'958	716'500	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		3'247	5'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.07.2024		2'621	4'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		613'677	542'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		921'033	164'767'000	CHF/JPY		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		11'905'317	13'302'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		1'361'617	1'419'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.08.2024		70'133	611'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.08.2024		46'255	70'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.08.2024		164'096	1'275'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.08.2024		24'099	287'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.08.2024		131'393	1'560'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		11'760	2'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		3'872	4'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		15'214	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		29'596	33'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		5'825	6'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		72'210	81'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		2'305	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.08.2024		4'512	800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		16'967	19'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		9'834	11'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		15'887	18'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.08.2024		2'291	2'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.08.2024		4'820	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		31'890	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.08.2024		25'682	29'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		301'848	508'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		471'996	722'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 06.08.2024		3'945	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 06.08.2024		1'815	3'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		11'887'278	13'534'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		1'350'295	1'419'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		624'865	554'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		487'082	766'500		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		302'552	529'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		957'437	164'527'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.09.2024		24'000	298'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		131'182	1'603'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		152'153	1'192'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		69'328	616'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.09.2024		48'585	74'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		41'574	48'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		4'120	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		43'938	51'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		2'518	4'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		1'913	15'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.09.2024		1'572	19'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		7'754	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		16'176	17'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.09.2024		35'000	29'679		USD/CHF	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.09.2024		8'002	14'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.09.2024		13'136	21'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.09.2024		1'834	17'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.09.2024		62'275	74'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.09.2024		5'561	5'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.09.2024		26'220	4'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.09.2024		14'052	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.09.2024		1'507	12'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		12'144'871	14'393'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		1'417'267	1'512'500		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.10.2024		642'219	576'600		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.10.2024		515'122	821'600		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.10.2024		323'807	563'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.10.2024		140'503	1'698'500		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.10.2024		25'097	311'900		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.10.2024		158'616	1'261'600		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		984'821	168'357'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.10.2024		49'286	75'800		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		10'999	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.10.2024		1'776	300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		10'918	13'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		3'383	4'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.10.2024		2'817	3'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.10.2024		18'620	22'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.10.2024		46'000	38'982		USD/CHF	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.10.2024		72'609	670'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.11.2024		644'693	573'700		CHF/GBP	-1'907.92	0.00	b)
	EUR/CHF Verfall 04.11.2024		1'461'188	1'557'200		CHF/EUR	-1'290.96	0.00	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 04.11.2024		12'439'443	14'821'000		CHF/USD	-15'022.37	-0.03	b)
	SEK/CHF Verfall 04.11.2024		147'588	1'773'100		CHF/SEK	358.85	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 04.11.2024		152'341	1'209'900		CHF/DKK	-139.96	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 04.11.2024		24'296	304'100		CHF/NOK	25.65	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 04.11.2024		333'760	573'300		CHF/AUD	-629.38	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 04.11.2024		532'139	856'000		CHF/CAD	-751.42	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 04.11.2024		80'022	740'400		CHF/HKD	-113.27	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 04.11.2024		53'170	81'000		CHF/SGD	-9.16	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 05.11.2024		1'008'089	169'987'000		CHF/JPY	4'754.38	0.01	b)

Devisentermingeschäfte

-14'725.56 -0.03

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	28'694.76	0.06
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	45'247'127.86	99.38
Derivative Finanzinstrumente	-14'725.56	-0.03
Sonstige Vermögenswerte	270'465.61	0.59
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	45'531'562.67	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-14'689.99	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	45'516'872.68	

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);	45'247'127.86	99.38
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-14'725.56	-0.03
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

Devisenkurse

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

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	16'948'281.46	37.235

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 Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
DT CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.068	0.00 - 0.09	-	0.029
FA CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.068	0.00 - 0.09	-	0.029
VT CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.068	0.00 - 0.09	-	0.029

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	1.10000	0.38500	0.71500

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	1.920	0.672	1.248
VT CHF 34)	Nein	CHF	1.954	-	1.954

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 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.