

# SWISSCANTO (CH) INDEX PRECIOUS METAL FUND GOLD PHYSICAL HEDGED

## Jahresbericht per 30.09.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
CTH1 CHF	42175632	CHF
GTH1 CHF	42175633	CHF
MTH1 CHF	51814215	CHF
NTH1 CHF	46505653	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Index Fund IV,

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) Index Precious Metal Fund Gold Physical
- ▶ Swisscanto (CH) Index Precious Metal Fund Gold Physical hedged

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 beigegefügte Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnungen“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

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



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

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



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

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

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

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in den Jahresrechnungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeits, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	14
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Pauschale Verwaltungskommission	15
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
11	Fussnoten	16
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	17

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (ab 03.01.2023)  
General Counsel, Zürcher Kantonalbank

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		386'614'541.03	781'048'768.79	1'109'250'104.69	1'156'018'786.58
<b>Klasse CTH1 CHF 14)</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		71'528'596.11	79'445'027.85	91'029'853.46	92'498'155.49
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		558'611.485	660'304.812	708'388.776	652'130.359
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		128.0471	120.3157	128.5027	141.8400
Total Expense Ratio (TER)		0.26 %	0.26 %	0.26 %	0.26 %
<b>Klasse GTH1 CHF 14)</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		118'255'825.90	481'593'475.77	751'363'470.81	780'745'283.16
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		920'661.404	3'992'689.178	5'835'871.091	5'497'168.885
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		128.4466	120.6188	128.7492	142.0268
Total Expense Ratio (TER)		0.20 %	0.20 %	0.20 %	0.20 %
<b>Klasse MTH1 CHF 14)</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'534'857.97	1'438'445.77	1'532'336.98	1'274'079.17
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		14'075.000	14'075.000	14'075.000	10'630.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		109.0485	102.1986	108.8694	119.8569
Thesaurierung je Anteil		-	-	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
<b>Klasse NTH1 CHF 14)</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		195'295'261.05	218'571'819.40	265'324'443.44	281'501'268.76
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'532'555.214	1'830'175.123	2'085'523.279	2'009'836.960
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		127.4311	119.4267	127.2220	140.0617
Thesaurierung je Anteil		-	-	-	-
Total Expense Ratio (TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %

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 CTH1 CHF	6.43 %	-2.88 %	-5.98 %	21.53 %
Klasse GTH1 CHF	6.49 %	-2.82 %	-5.92 %	21.61 %
Klasse MTH1 CHF (Lancierung 15.01.2020)	6.70 %	-2.63 %	-5.74 %	19.26 %
Klasse NTH1 CHF	6.70 %	-2.63 %	-5.74 %	21.85 %

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	449'251.36	18'738'417.92
Andere Anlagen - Edelmetalle	386'199'510.28	762'203'946.82
Derivative Finanzinstrumente	0.00	203'726.19
Sonstige Vermögenswerte	449.89	0.00
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>386'649'211.53</b>	<b>781'146'090.93</b>
Andere Verbindlichkeiten	-34'670.50	-97'322.14
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>386'614'541.03</b>	<b>781'048'768.79</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	Lancierung 01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Klasse CTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		660'304.812	708'388.776
Ausgegebene Anteile		36'783.207	109'770.161
Zurückgenommene Anteile		-138'476.534	-157'854.125
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>558'611.485</b>	<b>660'304.812</b>
<b>Klasse GTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		3'992'689.178	5'835'871.091
Ausgegebene Anteile		375'495.962	3'058'457.282
Zurückgenommene Anteile		-3'447'523.736	-4'901'639.195
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>920'661.404</b>	<b>3'992'689.178</b>
<b>Klasse MTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		14'075.000	14'075.000
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>14'075.000</b>	<b>14'075.000</b>
<b>Klasse NTH1 CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'830'175.123	2'085'523.279
Ausgegebene Anteile		499'447.113	411'125.456
Zurückgenommene Anteile		-797'067.022	-666'473.612
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'532'555.214</b>	<b>1'830'175.123</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		781'048'768.79	1'109'250'104.69
Saldo aus dem Anteilverkehr		-467'375'297.87	-263'875'348.64
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		72'941'070.11	-64'325'987.26
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>386'614'541.03</b>	<b>781'048'768.79</b>

## Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'024.39	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-5'152.50
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-42'183.89	-407'313.65
<b>Total Ertrag</b>		<b>-41'159.50</b>	<b>-412'466.15</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		0.00	-91.40
Reglementarische Vergütungen		-1'014'109.59	-1'449'372.07
Sonstige Aufwendungen		-84.00	-93.55
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		622'255.69	566'823.56
<b>Total Aufwand</b>		<b>-391'937.90</b>	<b>-882'733.46</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>-433'097.40</b>	<b>-1'295'199.61</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		47'090'895.59	-21'748'226.04
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		151'377.22	297'733.18
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>46'809'175.41</b>	<b>-22'745'692.47</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		26'131'894.70	-41'580'294.79
<b>Gesamterfolg</b>		<b>72'941'070.11</b>	<b>-64'325'987.26</b>

## Verwendung des Erfolges

<b>Klasse CTH1 CHF</b>			
Nettoertrag		-190'835.41	-228'403.65
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		190'835.41	228'403.65
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse GTH1 CHF</b>			
Nettoertrag		-242'577.58	-1'065'426.57
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		242'577.58	1'065'426.57
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>0.00</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse MTH1 CHF</b>			
Nettoertrag		2.39	-9.19
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		0.00	9.19
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>2.39</b>	<b>0.00</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		0.84	0.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		1.55	0.00
<b>Total</b>		<b>2.39</b>	<b>0.00</b>
<b>Klasse NTH1 CHF</b>			
Nettoertrag		313.20	-1'360.20
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten		0.00	1'360.20
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>		<b>313.20</b>	<b>0.00</b>
Thesaurierung: 35% Schweizerische Verrechnungssteuer		109.62	0.00
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage		203.58	0.00
<b>Total</b>		<b>313.20</b>	<b>0.00</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Andere Anlagen</b>							<b>386'199'510.28</b>	<b>99.88</b>	
<b>Edelmetalle</b>									
CH0002811286	GOLD BARREN 1 KILOGRAMM 999.9/1000	3'850'000	0	0	3'850'000 USD	60.14	211'804'574.73	54.78	a)
XD0002811053	GOLDBARREN (1 GRAMM) - 995	5'978'000	6'973'000	11'142'000	1'809'000 CHF	55.01	99'520'643.03	25.74	a)
XD0002811053	GOLDBARREN (1 GRAMM) - 995	4'580'000	650'000	3'869'000	1'361'000 USD	60.14	74'874'292.52	19.36	a)
<b>Total Edelmetalle</b>							<b>386'199'510.28</b>	<b>99.88</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	USD/CHF Verfall 05.10.2022		764'627'829	777'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.10.2022		757'935'761	765'060'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.10.2022		774'069'563	788'960'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		766'917'911	778'220'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.10.2022		774'272'388	782'820'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.10.2022		782'820'000	776'502'643	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.10.2022		764'310'363	770'600'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.10.2022		750'380'189	752'420'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.10.2022		755'010'960	756'330'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.10.2022		743'678'518	740'650'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.10.2022		742'892'262	740'420'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.10.2022		749'277'760	752'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.10.2022		744'140'320	748'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.10.2022		734'687'172	732'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.10.2022		736'464'416	736'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.10.2022		740'741'012	737'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.10.2022		742'429'989	742'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.10.2022		746'836'125	750'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.10.2022		749'256'717	759'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.11.2022		747'362'420	755'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		748'288'139	751'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.12.2022		24'325'000	22'630'715	USD/CHF		0.00	0.00	
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	
<b>Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)</b>									
	USD/CHF Verfall 03.11.2022		742'488'236	742'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.11.2022		742'000'000	741'569'640	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.11.2022		747'482'010	748'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.11.2022		748'000'000	747'154'760	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.11.2022		749'902'414	751'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.11.2022		751'000'000	761'048'380	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.11.2022		741'712'908	732'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.11.2022		732'000'000	730'623'840	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.11.2022		762'658'518	764'180'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.11.2022		764'180'000	756'171'394	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.11.2022		762'774'974	770'940'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.11.2022		770'940'000	759'275'678	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.11.2022		773'000'000	760'608'810	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.11.2022		760'972'893	773'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.11.2022		779'221'080	792'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 15.11.2022		792'000'000	766'038'240	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.11.2022		790'132'955	817'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.11.2022		817'000'000	772'571'540	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.11.2022		801'696'105	847'890'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.11.2022		847'890'000	801'273'008	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.11.2022		803'181'150	850'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.11.2022		850'000'000	801'227'000	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.11.2022		801'910'065	851'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.11.2022		851'000'000	812'645'430	USD/CHF		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall		798'234'536	836'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		836'000'000	794'974'136		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		791'082'656	832'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		832'000'000	797'954'560		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		823'640'000	784'451'209		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		789'762'863	823'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		789'054'956	828'740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		828'740'000	780'938'277		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		785'808'144	834'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		834'000'000	789'531'120		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		783'765'756	828'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		828'000'000	782'435'160		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		784'831'554	830'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		830'630'000	790'286'301		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		785'795'276	826'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		826'000'000	787'037'580		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		785'831'475	825'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		825'000'000	774'732'750		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		807'512'480	860'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		860'000'000	809'414'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		798'975'222	849'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		849'000'000	796'642'170		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		795'075'290	847'420'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		847'420'000	796'600'223		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		793'301'764	844'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		844'000'000	792'532'880		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		799'790'292	852'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		852'000'000	797'667'960		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		800'392'005	855'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		855'000'000	797'569'650		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		802'999'167	860'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		860'910'000	806'173'342		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		801'189'442	855'680'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		855'680'000	792'684'838		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		816'038'584	881'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		881'000'000	813'797'320		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		806'132'565	873'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		873'000'000	810'685'260		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		795'735'641	857'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		857'000'000	799'049'660		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		799'895'382	858'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		858'000'000	800'960'160		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		799'792'878	856'840'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		856'840'000	793'331'019		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		808'689'476	874'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		874'000'000	809'822'180		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		807'879'224	872'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		872'000'000	811'291'360		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		828'168'462	891'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		891'000'000	827'142'030		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		829'571'460	893'720'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		893'720'000	825'287'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		830'066'478	899'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		899'000'000	843'558'670		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		820'011'272	874'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		874'000'000	812'278'120		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		822'243'765	885'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		885'000'000	829'846'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		814'756'151	869'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		869'000'000	809'065'070		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		819'219'280	880'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		880'000'000	808'174'400		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		832'576'021	906'670'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		906'670'000	836'919'877		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		834'366'688	904'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		904'000'000	841'642'080		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		892'000'000	828'471'760		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		830'139'800	892'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		833'960'028	898'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		898'000'000	831'709'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		845'550'822	913'040'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		913'040'000	840'435'059		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall		849'514'432	923'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall		923'000'000	842'680'540		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 23.01.2023		854'285'796	936'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.01.2023		936'000'000	858'330'720		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.01.2023		853'657'175	931'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.01.2023		931'000'000	857'376'520		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.01.2023		854'526'528	928'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.01.2023		928'000'000	856'376'960		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.01.2023		849'979'203	921'160'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 26.01.2023		921'160'000	850'433'335		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.01.2023		850'200'428	921'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.01.2023		921'000'000	847'485'780		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.01.2023		859'191'270	934'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.01.2023		934'000'000	861'166'680		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.01.2023		859'235'964	932'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 31.01.2023		932'000'000	860'347'840		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.02.2023		851'026'284	922'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.02.2023		922'000'000	851'070'540		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		830'048'528	899'320'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2023		899'320'000	826'340'182		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.02.2023		683'115'957	743'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.02.2023		743'530'000	679'720'255		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.02.2023		684'280'907	748'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.02.2023		748'760'000	681'094'559		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.02.2023		681'729'866	749'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.02.2023		749'540'000	691'615'549		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.02.2023		665'450'344	721'260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.02.2023		721'260'000	669'487'957		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.02.2023		666'149'925	717'740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.02.2023		717'740'000	662'847'245		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.02.2023		662'092'857	717'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.02.2023		717'000'000	660'306'810		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.02.2023		665'615'490	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.02.2023		723'000'000	664'494'840		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.02.2023		668'098'097	727'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.02.2023		727'000'000	671'835'240		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.02.2023		661'598'320	716'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 15.02.2023		716'000'000	659'564'880		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.02.2023		660'414'002	717'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.02.2023		717'000'000	661'267'590		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.02.2023		650'129'498	705'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.02.2023		705'000'000	652'562'100		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.02.2023		688'000'000	637'136'160		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.02.2023		636'550'672	688'000'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.02.2023		635'215'077	686'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.02.2023		686'000'000	636'354'180		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.02.2023		638'270'494	688'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.02.2023		688'140'000	637'128'182		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.02.2023		636'003'303	687'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.02.2023		687'000'000	638'855'040		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.02.2023		637'717'948	686'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.02.2023		686'000'000	640'429'020		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.02.2023		634'758'240	680'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 28.02.2023		680'000'000	639'152'400		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.03.2023		634'374'450	675'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.03.2023		675'000'000	632'529'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		639'013'540	682'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.03.2023		682'000'000	639'156'760		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.03.2023		641'896'033	685'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.03.2023		685'000'000	643'434'200		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.03.2023		645'105'023	687'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.03.2023		687'000'000	646'762'410		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.03.2023		642'927'707	683'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.03.2023		683'000'000	641'623'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.03.2023		645'086'716	686'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.03.2023		686'760'000	640'149'599		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.03.2023		648'283'135	695'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.03.2023		695'560'000	654'195'047		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.03.2023		641'776'280	682'430'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.03.2023		682'430'000	641'777'645		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.03.2023		636'124'827	676'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.03.2023		676'640'000	633'862'819		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.03.2023		642'559'736	686'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.03.2023		686'000'000	630'626'080		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.03.2023		652'609'990	710'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 15.03.2023		710'000'000	647'470'300		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 16.03.2023		670'190'273	735'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.03.2023		735'000'000	671'473'950		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.03.2023		666'828'720	730'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.03.2023		730'000'000	674'687'900		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.03.2023		675'373'093	731'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 20.03.2023		731'000'000	679'734'970		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.03.2023		672'215'757	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.03.2023		723'000'000	671'435'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.03.2023		687'135'880	740'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.03.2023		740'000'000	685'854'200		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.03.2023		690'398'950	745'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.03.2023		745'000'000	688'208'650		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.03.2023		683'503'220	740'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.03.2023		740'000'000	683'552'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.03.2023		682'380'776	739'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.03.2023		739'000'000	675'837'670		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.03.2023		692'218'211	757'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 28.03.2023		757'000'000	694'835'160		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.03.2023		695'672'692	758'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.03.2023		758'000'000	694'797'960		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.03.2023		680'120'512	742'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.03.2023		742'070'000	683'357'422		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.03.2023		684'138'054	743'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 31.03.2023		743'000'000	683'136'490		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2023		684'663'195	745'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.04.2023		745'000'000	680'244'600		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		684'732'750	750'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.04.2023		750'000'000	685'215'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.04.2023		683'907'122	748'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.04.2023		748'650'000	683'277'882		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.04.2023		683'567'300	749'050'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.04.2023		749'050'000	679'598'084		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.04.2023		690'961'788	762'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.04.2023		762'000'000	689'366'160		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.04.2023		699'237'635	773'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.04.2023		773'000'000	699'039'360		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.04.2023		688'105'332	761'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.04.2023		761'000'000	687'776'580		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.04.2023		688'952'783	762'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.04.2023		762'390'000	684'039'180		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.04.2023		692'423'784	772'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.04.2023		772'000'000	686'060'960		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.04.2023		703'752'192	792'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.04.2023		792'000'000	707'984'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.04.2023		694'901'136	777'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.04.2023		777'450'000	698'632'119		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.04.2023		687'109'141	764'710'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 20.04.2023		764'710'000	686'571'932		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.04.2023		684'962'268	763'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.04.2023		763'000'000	685'570'760		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.04.2023		684'453'927	762'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.04.2023		762'000'000	680'984'160		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.04.2023		689'845'304	772'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.04.2023		772'000'000	689'951'840		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.04.2023		677'363'960	758'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 26.04.2023		758'000'000	673'619'440		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.04.2023		678'398'341	763'460'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.04.2023		763'460'000	681'143'743		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.04.2023		681'553'322	764'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 28.04.2023		764'000'000	680'250'320		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.05.2023		688'860'000	774'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.05.2023		774'000'000	694'216'080		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		680'222'309	758'480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.05.2023		758'480'000	675'032'030		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.05.2023		675'811'227	759'440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.05.2023		759'440'000	679'227'947		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.05.2023		680'544'036	761'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.05.2023		761'000'000	675'334'230		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.05.2023		689'211'821	777'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.05.2023		777'000'000	689'028'060		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.05.2023		697'815'586	787'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.05.2023		787'000'000	702'570'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.05.2023		681'962'444	764'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.05.2023		764'000'000	680'937'920		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 12.05.2023		692'448'026	777'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.05.2023		777'000'000	690'854'010		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.05.2023		695'961'720	783'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 15.05.2023		783'000'000	700'330'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.05.2023		687'733'618	769'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.05.2023		769'000'000	689'700'720		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.05.2023		689'643'294	769'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.05.2023		769'020'000	688'642'030		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.05.2023		688'643'500	769'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.05.2023		769'190'000	689'363'462		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.05.2023		683'591'538	763'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.05.2023		763'000'000	686'104'860		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.05.2023		676'137'488	752'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.05.2023		752'000'000	678'469'440		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.05.2023		673'885'134	747'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.05.2023		747'000'000	671'538'060		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.05.2023		677'381'005	753'580'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.05.2023		753'580'000	678'312'430		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.05.2023		675'017'250	750'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 26.05.2023		750'000'000	678'540'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.05.2023		675'537'498	747'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.05.2023		747'000'000	676'124'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.05.2023		668'809'411	739'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 31.05.2023		739'000'000	670'332'120		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 01.06.2023		671'157'800	740'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 01.06.2023		740'000'000	668'974'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		667'089'270	738'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		738'000'000	674'694'360		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.06.2023		660'759'099	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.06.2023		723'000'000	657'047'940		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.06.2023		662'426'991	729'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.06.2023		729'000'000	661'436'280		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.06.2023		658'640'994	726'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.06.2023		726'000'000	657'959'280		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.06.2023		657'895'379	726'010'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.06.2023		726'010'000	659'739'807		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.06.2023		656'933'345	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.06.2023		723'000'000	656'252'640		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.06.2023		662'393'240	730'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.06.2023		730'000'000	657'642'400		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.06.2023		660'275'405	733'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.06.2023		733'000'000	661'290'610		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.06.2023		658'513'290	730'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.06.2023		730'000'000	663'876'600		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.06.2023		656'449'367	721'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 15.06.2023		721'910'000	653'602'876		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.06.2023		654'518'525	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.06.2023		723'000'000	649'167'240		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.06.2023		731'000'000	653'821'020		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 20.06.2023		656'067'383	731'000'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.06.2023		652'854'695	730'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.06.2023		730'000'000	652'532'400		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.06.2023		657'760'251	735'930'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.06.2023		735'930'000	661'615'789		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.06.2023		648'121'320	721'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.06.2023		721'000'000	645'417'570		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.06.2023		643'437'414	719'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 26.06.2023		719'000'000	644'957'380		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.06.2023		643'992'868	718'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.06.2023		718'000'000	644'857'340		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.06.2023		648'384'158	722'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 28.06.2023		722'000'000	646'204'440		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.06.2023		645'111'372	720'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.06.2023		720'850'000	645'896'017		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.06.2023		643'610'312	718'370'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.06.2023		718'370'000	644'679'605		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.07.2023		638'760'832	712'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.07.2023		712'000'000	638'749'440		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.07.2023		709'000'000	634'257'220		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		635'931'169	709'000'000		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 06.07.2023		640'724'620	716'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 06.07.2023		716'300'000	641'955'223		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.07.2023		646'102'520	721'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.07.2023		721'000'000	647'270'540		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 10.07.2023		646'185'600	720'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.07.2023		720'000'000	645'724'800		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.07.2023		639'383'463	713'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.07.2023		713'000'000	634'577'130		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 12.07.2023		643'412'160	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 12.07.2023		723'000'000	642'284'280		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 13.07.2023		646'349'666	727'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 13.07.2023		727'650'000	641'867'342		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.07.2023		649'643'747	736'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.07.2023		736'540'000	638'808'507		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.07.2023		654'525'865	754'890'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.07.2023		754'890'000	648'533'548		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.07.2023		657'400'946	765'290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.07.2023		765'290'000	658'218'276		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 19.07.2023		654'033'042	760'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 19.07.2023		760'500'000	654'364'620		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 20.07.2023		654'290'994	760'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 20.07.2023		760'490'000	652'203'829		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.07.2023		662'240'832	772'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.07.2023		772'270'000	663'835'569		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.07.2023		663'494'098	772'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.07.2023		772'100'000	668'244'829		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.07.2023		665'210'477	768'670'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.07.2023		768'670'000	665'660'533		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 26.07.2023		657'853'626	759'730'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 26.07.2023		759'730'000	657'926'180		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 27.07.2023		657'861'223	759'730'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 27.07.2023		759'730'000	657'918'583		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 28.07.2023		655'484'408	757'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 28.07.2023		757'000'000	653'374'270		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.07.2023		659'749'526	764'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 31.07.2023		764'630'000	664'455'824		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.08.2023		654'207'906	753'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.08.2023		753'000'000	653'310'330		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		655'839'828	756'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		756'000'000	655'308'360		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.08.2023		661'302'401	763'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.08.2023		763'000'000	669'601'170		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 07.08.2023		650'959'568	742'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 07.08.2023		742'000'000	649'761'980		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 08.08.2023		648'816'636	741'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 08.08.2023		741'000'000	646'159'410		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 09.08.2023		653'065'084	749'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 09.08.2023		749'000'000	654'993'010		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 10.08.2023		648'266'968	741'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 10.08.2023		741'390'000	649'376'087		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 11.08.2023		646'336'341	738'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 11.08.2023		738'000'000	646'938'180		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 14.08.2023		646'819'173	738'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 14.08.2023		738'100'000	644'885'351		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 15.08.2023		646'475'840	740'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 15.08.2023		740'000'000	647'936'600		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 16.08.2023		642'612'596	734'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 16.08.2023		734'000'000	645'472'260		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 17.08.2023		639'720'829	727'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 17.08.2023		727'540'000	637'259'561		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 18.08.2023		638'467'313	729'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 18.08.2023		729'000'000	640'783'710		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 21.08.2023		639'696'512	728'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 21.08.2023		728'000'000	639'467'920		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 22.08.2023		637'642'533	726'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 22.08.2023		726'000'000	639'816'540		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 23.08.2023		637'105'070	723'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 23.08.2023		723'000'000	636'738'870		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 24.08.2023		634'830'102	720'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 24.08.2023		720'910'000	634'444'055		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 25.08.2023		635'696'599	722'410'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 25.08.2023		722'410'000	635'186'217		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 29.08.2023		644'704'638	733'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 29.08.2023		733'540'000	647'121'653		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 30.08.2023		644'715'511	730'890'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 30.08.2023		730'890'000	648'365'210		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 31.08.2023		645'537'221	727'780'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 31.08.2023		727'780'000	641'545'348		USD/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.	
	USD/CHF Verfall 01.09.2023		647'340'557	734'440'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 01.09.2023		734'440'000	643'890'892		USD/CHF	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		745'000'000	658'088'300		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		652'869'575	745'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 06.09.2023		391'277'535	443'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 06.09.2023		443'000'000	391'696'170		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 07.09.2023		390'769'548	442'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 07.09.2023		442'000'000	393'044'080		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 08.09.2023		384'111'720	432'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 08.09.2023		432'000'000	385'814'880		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 11.09.2023		383'908'730	430'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 11.09.2023		430'000'000	383'964'200		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 12.09.2023		382'137'446	428'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 12.09.2023		428'000'000	381'651'880		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 13.09.2023		385'177'248	432'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 13.09.2023		432'000'000	385'123'680		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 14.09.2023		384'190'814	431'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 14.09.2023		431'000'000	384'792'490		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 15.09.2023		380'287'857	426'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 15.09.2023		426'000'000	380'294'460		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 18.09.2023		381'067'183	427'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 18.09.2023		427'000'000	381'947'230		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 19.09.2023		378'328'662	423'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 19.09.2023		423'000'000	379'392'930		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 20.09.2023		383'836'178	428'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 20.09.2023		428'000'000	384'318'320		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 21.09.2023		383'378'961	427'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 21.09.2023		427'000'000	383'322'170		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 22.09.2023		385'075'763	429'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 22.09.2023		429'000'000	383'744'790		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 25.09.2023		386'307'576	432'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 25.09.2023		432'000'000	390'074'400		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 26.09.2023		380'100'271	421'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 26.09.2023		421'000'000	381'383'900		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 27.09.2023		383'153'823	423'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 27.09.2023		423'000'000	386'368'200		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 28.09.2023		382'673'748	419'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 28.09.2023		419'000'000	382'861'250		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 29.09.2023		379'166'410	415'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 29.09.2023		415'000'000	381'758'500		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 02.10.2023		375'183'744	408'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 02.10.2023		408'000'000	373'932'000		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		386'722'066	422'000'000		CHF/USD	0.00	0.00		
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		422'000'000	386'066'700		USD/CHF	0.00	0.00		
	USD/CHF Verfall 04.10.2023		385'111'013	421'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	b)	
<b>Devisentermingeschäfte auf Klassen</b>								<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	

Vermögensaufstellung	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	449'251.36	0.12
Andere Anlagen - Edelmetalle	386'199'510.28	99.88
Sonstige Vermögenswerte	449.89	0.00
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>386'649'211.53</b>	<b>100.00</b>
Andere Verbindlichkeiten	-34'670.50	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>386'614'541.03</b>	

Bewertungskategorien	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	386'199'510.28	99.88
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a) verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	0.00	0.00
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

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	385'130'800.00	99.616

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

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabe- spesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahme- spesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
CTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.012	0.00 - 0.02	-	0.006
GTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.012	0.00 - 0.02	-	0.006
MTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.012	0.00 - 0.02	-	0.006
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.05	-	0.012	0.00 - 0.02	-	0.006

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
CTH1 CHF	0.260	0.750	0.160	0.100	-
GTH1 CHF	0.200	0.600	0.150	0.050	-
MTH1 CHF	-	-	-	-	-
NTH1 CHF	-	-	-	-	-

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 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

**Ex-Datum:** 17.01.2024

**Thesaurierung an Anteilscheininhaber**

**Zahlbar:** 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
CTH1 CHF	Nein	CHF	-	-	-
GTH1 CHF	Nein	CHF	-	-	-
MTH1 CHF	Nein	CHF	0.00016	0.00005	0.00011
NTH1 CHF	Nein	CHF	0.00020	0.00007	0.00013

## 11 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.0001 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.
- 14) Neue Klassenbezeichnung per 14.09.2022: von CTH CHF Klasse in CTH1 CHF, von GTH CHF Klasse in GTH1 CHF, von MTH CHF Klasse in MTH1 CHF und von NTH CHF Klasse in NTH1 CHF.
- 28) Sämtliche engagementerhöhenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch geldnahe Mittel gedeckt. Sämtliche engagementreduzierenden Derivate (netto nach Verrechnung gegenläufiger Positionen) sind durch die entsprechenden Basiswerte gedeckt.
- 30) Darstellung der Angaben in Prozent des Nettoinventarwertes.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet.

Für Tage, an welchen der Handel des Edelmetalls am für das Teilvermögen relevanten Markt geschlossen ist (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt. Für Tage, an welchen für den Goldhandel in London keine Nachmittags-Schlusskurse (LBMA Gold Price PM) festgelegt werden, findet keine Berechnung des Vermögens des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Precious Metal Fund Gold Physical sowie des Teilvermögens Swisscanto (CH) Index Precious Metal Fund Gold Physical hedged statt.

2. Für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Precious Metal Fund Gold Physical sowie für das Teilvermögen Swisscanto (CH) Index Precious Metal Fund Gold Physical hedged wird der Wert des Goldes aufgrund der Nachmittags-Schlusskurse des Goldhandels in London (LBMA Gold Price PM) berechnet.
3. 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.
4. 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. 3 bewerten.
5. Die als Bankguthaben gehaltenen flüssigen Mittel werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. 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 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle zum Prospekt) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
7. 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 Anteilsklasse 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 Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.