

SWISSCANTO (CH) IPF I INDEX EQUITY FUND WORLD EX CH

Jahresbericht per 30.04.2024

Teilvermögen des Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I)
Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen für qualifizierte Anleger»

Klasse	Valor	Währung
NT CHF	11704494	CHF
NTH1 CHF	29659028	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. August 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund I (IPF I),

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund USA
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund USA Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund World (ex CH) Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Real Estate Fund North America indirect
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund Small Cap World ex CH
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund Small Cap World (ex CH) Responsible
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Equity Fund Systematic Responsible World Enhanced
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund Japan
- ▶ Swisscanto (CH) IPF I Index Equity Fund Japan Responsible

bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. April 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.



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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

- ▶ Jahresrechnungen bestehend aus den Vermögensrechnungen zum 30. April 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	17
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	17
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	18
7	Pauschale Verwaltungskommission	18
8	Benchmark	18
9	TER	18
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2023 / 2024	19
11	Fussnoten	19
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	20

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	01.05.2023	01.05.2022	01.05.2021	01.05.2020
	bis	30.04.2024	30.04.2023	30.04.2022	30.04.2021
Konsolidiert					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'274'184'689.88	1'757'328'872.78	1'651'209'774.52	1'867'833'915.44
Klasse NT CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'639'587'005.90	1'329'047'130.54	1'278'091'715.35	1'487'911'441.79
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		5'044'927.393	5'038'683.702	4'605'306.062	5'511'243.779
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		324.9971	263.7687	277.5259	269.9774
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode in USD		354.3555	296.3527	285.9176	296.0117
Thesaurierung je Anteil		5.36	5.31	4.16	4.57
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.00 %	0.00 %	0.00 %	0.00 %
Klasse NTH1 CHF					
	CHF				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		634'597'683.98	428'281'742.24	373'118'059.17	379'922'473.65
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'957'444.130	2'326'957.107	2'046'004.220	2'047'036.970
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode 1)		214.5764	184.0523	182.3643	185.5963
Thesaurierung je Anteil		3.75	3.55	2.88	3.16
Total Expense Ratio (Synthetische 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

	2023 / 2024	2023	2022	2021
Klasse NT CHF	23.21 %	13.37 %	-16.56 %	26.13 %
Klasse NTH1 CHF	16.58 %	19.16 %	-17.84 %	23.26 %
Benchmark Hedge	16.05 %	18.56 %	-	-
Benchmark	22.69 %	12.82 %	-16.87 %	25.65 %
Tracking Error 33)	0.16 %	0.16 %	0.16 %	0.34 %

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.

Tracking Differenz

Klasse

Klasse NT CHF	0.52 %
Klasse NTH1 CHF	0.53 %

Die Tracking Differenz ist insbesondere auf die Fondskosten (siehe Total Expense Ratio) und sofern anwendbar auf nicht rückforderbare Quellensteuern sowie auf Erträge aus Effektenleihe zurückzuführen. Der Portfoliomanager des Teilvermögens strebt an, den Index so genau wie möglich und zweckmässig nachzubilden um die verbleibende Tracking Differenz so tief wie möglich zu halten. Die Tracking Differenz ist in Prozentpunkten angegeben. Neulancierungen sowie zur Fondswährung abweichende Klassenwährungen können zur Verzerrung der Tracking Differenz führen.

Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.04.2024	30.04.2023
Bankguthaben auf Sicht	10'515'788.59	31'914'521.68
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	75'454'939.04	62'454'799.17
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	2'196'444'568.06	1'660'077'379.79
Derivative Finanzinstrumente	-0.01	-268.94
Sonstige Vermögenswerte	3'218'888.68	2'882'959.12
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'285'634'184.36	1'757'329'390.82
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-11'449'494.48	0.00
Andere Verbindlichkeiten	0.00	-518.04
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'274'184'689.88	1'757'328'872.78

Entwicklung der Anzahl Anteile

Klasse NT CHF	von	01.05.2023	Lancierung
	bis	30.04.2024	30.04.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		5'038'683.702	4'605'306.062
Ausgegebene Anteile		556'592.180	801'880.645
Ausgegebene Anteile (Sacheinlagen)		-	14'434.371
Zurückgenommene Anteile		-550'348.489	-382'937.376
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		5'044'927.393	5'038'683.702

Klasse NTH1 CHF	von	01.05.2023	01.05.2022
	bis	30.04.2024	30.04.2023
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'326'957.107	2'046'004.220
Ausgegebene Anteile		800'398.935	382'510.708
Zurückgenommene Anteile		-169'911.912	-101'557.821
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'957'444.130	2'326'957.107

Veränderung des Nettofondsvermögens

Konsolidiert	von	01.05.2023	01.05.2022
	bis	30.04.2024	30.04.2023
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		1'757'328'872.78	1'651'209'774.52
Saldo aus dem Anteilverkehr		114'121'110.97	158'921'623.86
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		402'734'706.13	-52'802'525.60
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		2'274'184'689.88	1'757'328'872.78

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von	01.05.2023	01.05.2022
	bis	30.04.2024	30.04.2023
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		449'731.30	99'535.97
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-3'637.23	-9'109.37
Erträge der Aktien und sonstigen Beteiligungswertpapiere und -rechte		2'181'979.60	2'048'443.05
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		34'351'075.10	30'690'163.95
Erträge aus Wertpapierleihe		4.40	454.55
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		4'342'951.81	3'988'802.98
Total Ertrag		41'322'104.98	36'818'291.13
Aufwand			
Passivzinsen		-30'756.84	-573.62
Sonstige Aufwendungen		-80.00	-345.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-3'131'760.08	-1'770'609.02
Total Aufwand		-3'162'596.92	-1'771'527.64
Nettoertrag / Verlust		38'159'508.06	35'046'763.49
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		-17'004'039.65	18'824'321.53
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		262'425.32	224'969.10
Realisierter Erfolg		21'417'893.73	54'096'054.12
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		381'316'812.40	-106'898'579.72
Gesamterfolg		402'734'706.13	-52'802'525.60

Verwendung des Erfolges

Klasse NT CHF	30.04.2024	30.04.2023
Nettoertrag	27'059'221.39	26'772'362.15
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	27'059'221.39	26'772'362.15
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	27'059'221.39	26'772'362.15
Total	27'059'221.39	26'772'362.15

Klasse NTH1 CHF	30.04.2024	30.04.2023
Nettoertrag	11'100'286.67	8'274'401.34
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	11'100'286.67	8'274'401.34
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	11'100'286.67	8'274'401.34
Total	11'100'286.67	8'274'401.34

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
Wertpapiere, die an einer Börse kotiert sind							75'454'939.04	3.30	
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte							75'454'939.04	3.30	
CA00208D4084	ARC RESOURCES LTD	22'335	8'902	7'439	23'798 CAD	24.93	396'062.56	0.02	a)
CA0084741085	AGNICO EAGLE MINES LTD	20'519	651	1'016	20'154 CAD	87.18	1'172'949.12	0.05	a)
CA0089118776	AIR CANADA	5'773	1'685	0	7'458 CAD	20.32	101'168.93	0.00	a)
CA0158571053	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	24'243	1'984	26'227	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA01626P1484	ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	27'816	3'891	561	31'146 CAD	76.30	1'586'455.41	0.07	a)
CA0213611001	ALTAGAS LTD	11'008	1'498	0	12'506 CAD	30.18	251'964.13	0.01	a)
CA05534B7604	BCE INC	3'918	0	873	3'045 CAD	45.23	91'942.21	0.00	a)
CA05577W2004	BRP INC/CA- SUB VOTING	1'244	62	0	1'306 CAD	92.62	80'751.20	0.00	a)
CA0636711016	BANK OF MONTREAL	23'858	7'034	1'465	29'427 CAD	122.97	2'415'717.89	0.11	a)
CA0641491075	BANK OF NOVA SCOTIA	42'511	10'181	4'577	48'115 CAD	63.16	2'028'727.26	0.09	a)
CA0679011084	BARRICK GOLD CORP	62'312	16'172	7'506	70'978 CAD	22.88	1'084'128.67	0.05	a)
CA11271J1075	BROOKFIELD CORP	51'665	9'092	3'880	56'877 CAD	55.22	2'096'689.58	0.09	a)
CA1130041058	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	11'911	2'239	0	14'150 CAD	52.59	496'776.07	0.02	a)
CA1247651088	CAE INC	14'692	1'055	2'868	12'879 CAD	26.56	228'355.39	0.01	a)
CA1249003098	CCL INDUSTRIES INC - CL B	5'906	0	0	5'906 CAD	70.30	277'172.30	0.01	a)
CA12532H1047	CGI INC	8'057	508	815	7'750 CAD	139.49	721'681.93	0.03	a)
CA13321L1085	CAMECO CORP	15'209	4'524	1'880	17'853 CAD	62.81	748'584.88	0.03	a)
CA1349211054	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3'160	874	139	3'895 CAD	42.85	111'419.02	0.00	a)
CA1360691010	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	32'639	5'406	0	38'045 CAD	64.26	1'632'072.18	0.07	a)
CA1363751027	CANADIAN NATL RAILWAY CO	20'947	2'672	1'833	21'786 CAD	167.09	2'430'127.23	0.11	a)
CA1363851017	CANADIAN NATURAL RESOURCES	39'305	5'887	2'225	42'967 CAD	104.32	2'992'289.88	0.13	a)
CA13646K1084	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	34'208	5'577	2'501	37'284 CAD	108.00	2'688'111.68	0.12	a)
CA1366812024	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2'316	0	179	2'137 CAD	132.99	189'725.00	0.01	a)
CA1367178326	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4'908	0	0	4'908 CAD	30.78	100'849.61	0.00	a)
CA15135U1093	CENOVUS ENERGY INC	59'383	3'304	5'370	57'317 CAD	28.28	1'082'091.31	0.05	a)
CA21037X1006	CONSTELLATION SOFTWARE INC	720	146	44	822 CAD	3'544.28	1'944'916.21	0.09	a)
CA2499061083	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3'473	0	0	3'473 CAD	127.70	296'071.59	0.01	a)
CA25675T1075	DOLLARAMA INC	9'772	2'787	1'252	11'307 CAD	114.84	866'845.36	0.04	a)
CA2861812014	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	16'732	0	1'010	15'722 CAD	21.97	230'589.17	0.01	a)
CA2908761018	EMERA INC	8'867	3'382	2'291	9'958 CAD	46.43	308'653.96	0.01	a)
CA2918434077	EMPIRE CO LTD 'A'	7'856	0	2'195	5'661 CAD	32.07	121'197.36	0.01	a)
CA29250N1050	ENBRIDGE INC	76'324	13'291	2'543	87'072 CAD	48.95	2'845'327.55	0.12	a)
CA3039011026	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	883	0	73	810 CAD	1'496.71	809'326.45	0.04	a)
CA3359341052	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	20'390	3'968	0	24'358 CAD	17.48	284'239.29	0.01	a)
CA33767E2024	FIRSTSERVICE CORP	1'843	0	233	1'610 CAD	202.20	217'324.20	0.01	a)
CA3495531079	FORTIS INC	17'170	3'335	810	19'695 CAD	54.06	710'776.53	0.03	a)
CA3518581051	FRANCO-NEVADA CORP	6'480	1'251	0	7'731 CAD	165.72	855'286.57	0.04	a)
CA36168Q1046	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	8'575	628	0	9'203 CAD	43.93	269'893.04	0.01	a)
CA3759161035	GILDAN ACTIVEWEAR INC	6'063	725	491	6'297 CAD	47.72	200'601.96	0.01	a)
CA39138C1068	GREAT-WEST LIFECO INC	11'833	1'746	2'422	11'157 CAD	40.71	303'214.24	0.01	a)
CA4488112083	HYDRO ONE LTD	12'953	0	0	12'953 CAD	38.56	333'432.90	0.01	a)
CA4495861060	IGM FINANCIAL INC	3'446	0	0	3'446 CAD	34.41	79'159.13	0.00	a)
CA45075E1043	IA FINANCIAL CORP INC	4'281	0	0	4'281 CAD	83.46	238'519.92	0.01	a)
CA4530384086	IMPERIAL OIL LTD	7'980	0	497	7'483 CAD	94.65	472'821.72	0.02	a)
CA45823T1066	INTACT FINANCIAL CORP	6'209	1'928	866	7'271 CAD	226.27	1'098'303.01	0.05	a)
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	19'449	7'847	0	27'296 CAD	18.66	340'025.67	0.01	a)
CA4932711001	KEYERA CORP	8'470	1'251	0	9'721 CAD	35.32	229'209.54	0.01	a)
CA4969024047	KINROSS GOLD CORP	56'999	0	7'615	49'384 CAD	8.88	292'752.28	0.01	a)
CA5394811015	LOBLAW COMPANIES LTD	5'245	1'366	290	6'321 CAD	150.96	637'013.64	0.03	a)
CA5503721063	LUNDIN MINING CORP	23'983	2'065	0	26'048 CAD	15.72	273'355.60	0.01	a)
CA5527041084	MEG ENERGY CORP	0	11'375	0	11'375 CAD	31.31	237'758.21	0.01	a)
CA5592224011	MAGNA INTERNATIONAL INC	9'076	2'677	637	11'116 CAD	65.80	488'287.36	0.02	a)
CA56501R1064	MANULIFE FINANCIAL CORP	66'551	7'922	672	73'801 CAD	32.11	1'581'989.53	0.07	a)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CA59162N1096	METRO INC/CN	7'957	3'645	2'033	9'569 CAD	70.42	449'845.76	0.02	a)
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	12'128	1'834	950	13'012 CAD	110.54	960'206.34	0.04	a)
CA6665111002	NORTHLAND POWER INC	11'549	0	0	11'549 CAD	21.01	161'983.76	0.01	a)
CA67077M1086	NUTRIEN LTD	18'913	3'752	2'410	20'255 CAD	72.59	981'544.73	0.04	a)
CA67079A1021	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	2'162	0	2'162	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA68272K1030	ONEX CORPORATION	2'002	528	0	2'530 CAD	97.67	164'961.56	0.01	a)
CA6837151068	OPEN TEXT CORP	11'871	1'256	1'849	11'278 CAD	48.61	365'981.19	0.02	a)
CA6979001089	PAN AMERICAN SILVER CORP	8'952	5'861	0	14'813 CAD	25.39	251'076.91	0.01	a)
CA70137W1086	PARKLAND CORP	5'873	0	0	5'873 CAD	42.41	166'275.91	0.01	a)
CA7063271034	PEMBINA PIPELINE CORP	18'390	6'809	4'932	20'267 CAD	48.44	655'382.22	0.03	a)
CA7392391016	POWER CORP OF CANADA	20'784	7'758	5'223	23'319 CAD	36.68	571'005.51	0.02	a)
CA7481932084	QUEBECOR INC -CL B	4'799	975	0	5'774 CAD	28.49	109'817.18	0.00	a)
CA74935Q1072	RB GLOBAL INC	0	7'706	409	7'297 CAD	98.50	479'823.63	0.02	a)
CA76131D1033	RESTAURANT BRANDS INTERN	9'647	4'485	2'072	12'060 CAD	104.44	840'843.60	0.04	a)
CA7669101031	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6'087	0	0	6'087 CAD	17.44	70'868.11	0.00	a)
CA7677441056	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	7'706	0	7'706	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	11'634	3'081	0	14'715 CAD	51.57	506'592.14	0.02	a)
CA7800871021	ROYAL BANK OF CANADA	51'060	7'952	2'325	56'687 CAD	133.19	5'040'297.21	0.22	a)
CA8029121057	SAPUTO INC	9'383	309	0	9'692 CAD	26.47	171'264.91	0.01	a)
CA82509L1076	SHOPIFY INC - CLASS A	44'761	6'574	2'622	48'713 CAD	96.65	3'143'024.66	0.14	a)
CA85472N1096	STANTEC INC	0	4'782	0	4'782 CAD	109.61	349'913.58	0.02	a)
CA8667961053	SUN LIFE FINANCIAL INC	18'853	6'993	2'087	23'759 CAD	70.29	1'114'866.21	0.05	a)
CA8672241079	SUNCOR ENERGY INC	47'815	8'647	3'465	52'997 CAD	52.53	1'858'487.91	0.08	a)
CA87241L1094	TFI INTERNATIONAL INC	2'747	504	0	3'251 CAD	179.28	389'089.82	0.02	a)
CA87262K1057	TMX GROUP LTD	2'533	14'922	5'623	11'832 CAD	36.45	287'910.00	0.01	a)
CA87807B1076	TC ENERGY CORP	36'411	6'092	0	42'503 CAD	49.32	1'399'405.92	0.06	a)
CA8787422044	TECK RESOURCES LTD-CLS B	15'735	2'983	0	18'718 CAD	67.69	845'833.75	0.04	a)
CA87971M9969	TELUS CORP-W/I	15'309	4'045	0	19'354 CAD	22.10	285'538.10	0.01	a)
CA8849037095	THOMSON REUTERS CORP	6'524	0	6'524	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
CA8849038085	THOMSON REUTERS CORP	0	6'524	0	6'524 CAD	207.93	905'591.13	0.04	a)
CA8911021050	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3'431	0	0	3'431 CAD	126.00	288'597.34	0.01	a)
CA8911605092	TORONTO-DOMINION BANK	65'059	13'032	5'965	72'126 CAD	81.67	3'932'379.80	0.17	a)
CA89156V1067	TOURMALINE OIL CORP	13'017	721	0	13'738 CAD	67.28	617'036.06	0.03	a)
CA92938W2022	WSP GLOBAL INC	4'898	200	0	5'098 CAD	208.89	710'916.40	0.03	a)
CA9528451052	WEST FRASER TIMBER CO LTD	2'294	0	0	2'294 CAD	105.44	161'472.98	0.01	a)
CA9611485090	WESTON (GEORGE) LTD	2'897	234	618	2'513 CAD	181.17	303'934.38	0.01	a)
CA9628791027	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	15'362	4'915	1'664	18'613 CAD	71.72	891'164.16	0.04	a)
CA							71'005'638.30	3.11	
IL0002300114	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	71'777	0	71'777	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0002730112	NICE LTD	2'228	397	42	2'583 ILS	83'740.00	531'500.57	0.02	a)
IL0002810146	ICL GROUP LTD	28'866	2'962	0	31'828 ILS	1'762.00	137'803.94	0.01	a)
IL0005930388	FIRST INTL BANK ISRAEL	1'962	0	1'962	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0006046119	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57'815	4'670	1'385	61'100 ILS	2'930.00	439'901.26	0.02	a)
IL0006625771	BANK HAPOALIM BM	43'822	9'869	2'700	50'991 ILS	3'386.00	424'254.89	0.02	a)
IL0006912120	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	36'507	21'538	7'243	50'802 ILS	1'928.00	240'676.79	0.01	a)
IL0006954379	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5'254	1'122	0	6'376 ILS	13'670.00	214'172.25	0.01	a)
IL0010811243	ELBIT SYSTEMS LTD	0	1'092	0	1'092 ILS	76'400.00	205'004.02	0.01	a)
IL0010823792	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	5'329	0	5'329	0 ILS	0.00	0.00	0.00	
IL0010824113	CHECK POINT SOFTWARE TECH	4'677	0	905	3'772 USD	149.42	516'916.97	0.02	a)
IL0011194789	AZRIELI GROUP LTD	1'696	0	0	1'696 ILS	24'210.00	100'894.39	0.00	a)
IL0011301780	WIX.COM LTD	2'029	198	0	2'227 USD	118.87	242'791.15	0.01	a)
IL0011334468	CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1'768	0	94	1'674 USD	239.25	367'322.70	0.02	a)
IL0011741688	GLOBAL-E ONLINE LTD	0	4'044	0	4'044 USD	33.53	124'361.25	0.01	a)
IL0011762130	MONDAY.COM LTD	0	1'188	0	1'188 USD	189.33	206'289.08	0.01	a)
US8816242098	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	41'821	7'267	3'815	45'273 USD	14.05	583'385.95	0.03	a)
IL							4'335'275.21	0.19	
CA11284V1058	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4'539	802	0	5'341 CAD	31.98	114'025.53	0.00	a)
US							114'025.53	0.00	
Bezugsrechte							0.00	0.00	
CA21037X1428	CONSTELLATION SOFTWARE-RTS	0	773	773	0 CAD	0.00	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
----------------------------	-------------	------------------------------------	----------------------	-------------------------	---	------------	-----------------	------------	------

Diverse 0.00 0.00

Wertpapiere, die an einem anderen regelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden

2'196'444'568.06 96.10

Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen

2'196'444'568.06 96.10

CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	1'964'912	285'058	156'258	2'093'712 CHF	165.48	346'459'168.82	15.16	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	470'066	75'979	41'822	504'223 CHF	129.89	65'494'187.17	2.87	a)
CH0414225430	SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD	8'234	1'272	611	8'895 USD	201'300.42	1'642'247'173.11	71.85	a)
CH0512828978	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN ST	1'297	188	88	1'397 JPY	17'475'170.86	142'244'038.96	6.22	a)

CH 2'196'444'568.06 96.10

Derivative Finanzinstrumente

-0.01 0.00

Optionen und Optionsscheine

0.00 0.00

CA21037X1345	CONSTELLATION SOFTWARE --- WARRANT	0	773	0	773 CAD	0.00	0.00	0.00	a)
--------------	---------------------------------------	---	-----	---	---------	------	------	------	----

Futures

0.00 0.00

06/23	TOPIX INDX FUTR JUN23	16	2	18	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
06/23	SPI 200 FUTURES JUN23	11	1	12	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/23	EURO STOXX 50 JUN23	91	25	116	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P500 EMINI FUT JUN23	125	37	162	0 USD	0.00	0.00	0.00	
06/23	FTSE 100 IDX FUT JUN23	20	3	23	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
06/23	S&P/TSX 60 IX FUT JUN23	7	2	9	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	TOPIX INDX FUTR SEP23	0	19	19	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
09/23	EURO STOXX 50 SEP23	0	113	113	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P500 EMINI FUT SEP23	0	157	157	0 USD	0.00	0.00	0.00	
09/23	FTSE 100 IDX FUT SEP23	0	24	24	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
09/23	S&P/TSX 60 IX FUT SEP23	0	9	9	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
09/23	SPI 200 FUTURES SEP23	0	13	13	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
12/23	TOPIX INDX FUTR DEC23	0	17	17	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
12/23	EURO STOXX 50 DEC23	0	90	90	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P500 EMINI FUT DEC23	0	133	133	0 USD	0.00	0.00	0.00	
12/23	FTSE 100 IDX FUT DEC23	0	20	20	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
12/23	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	0	8	8	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
12/23	SPI 200 FUTURES DEC23	0	15	15	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
03/24	TOPIX INDX FUTR MAR24	0	31	31	0 JPY	0.00	0.00	0.00	
03/24	EURO STOXX 50 MAR24	0	169	169	0 EUR	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P500 EMINI FUT MAR24	0	238	238	0 USD	0.00	0.00	0.00	
03/24	FTSE 100 IDX FUT MAR24	0	36	36	0 GBP	0.00	0.00	0.00	
03/24	S&P/TSX 60 IX FUT MAR24	0	15	15	0 CAD	0.00	0.00	0.00	
03/24	SPI 200 FUTURES MAR24	0	18	18	0 AUD	0.00	0.00	0.00	
06/24	TOPIX INDX FUTR JUN24	0	11	5	6 JPY	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	SPI 200 FUTURES JUN24	0	5	2	3 AUD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	EURO STOXX 50 JUN24	0	41	13	28 EUR	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	S&P500 EMINI FUT JUN24	0	61	21	40 USD	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	FTSE 100 IDX FUT JUN24	0	9	4	5 GBP	0.00	0.00	0.00	a)
06/24	S&P/TSX 60 IX FUT JUN24	0	3	1	2 CAD	0.00	0.00	0.00	a)

Devisentermingeschäfte

CHF/EUR	Verfall 08.05.2023	750'000	736'865		EUR/CHF	0.00	0.00
GBP/CAD	Verfall 03.08.2023	321'757	190'000		CAD/GBP	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 23.08.2023	184'508	250'000		USD/CAD	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 29.08.2023	440'042	600'000		USD/CAD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall 04.12.2023	900'000	663'848		CAD/USD	0.00	0.00
USD/CAD	Verfall 15.12.2023	680'000	501'009		CAD/USD	0.00	0.00
CAD/USD	Verfall 02.05.2024	218'360	300'000		USD/CAD	0.00	0.00

Devisentermingeschäfte 0.00 0.00

Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		3'896'232	29'601'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		9'163'466	15'614'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		293'558'341	330'990'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		800'511	9'636'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		14'507'029	22'172'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		26'368'761	4'030'916'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.06.2023		262'930	480'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		4'283'570	49'469'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		42'829'907	43'665'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		19'059'348	17'086'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.06.2023		505'703	2'072'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		3'232'379	28'572'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		195'859	200'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		1'149'948	1'300'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		202'624	208'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		1'154'825	1'306'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		1'044'223	1'177'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		335'185	344'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		239'653	214'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		278'418	42'060'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		295'503	2'593'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		362'973	4'197'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		1'316'455	1'987'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		328'047	2'505'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		3'002'300	3'078'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		864'371	1'444'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		2'116'859	317'977'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		1'352'855	1'210'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		22'993'426	25'763'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		85'503	1'030'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		169'720	189'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		44'330	75'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		162'518	167'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		163'630	181'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		59'220	89'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		735'472	811'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		90'299	93'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		72'297	11'197'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		73'818	66'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		53'666'000	4'507'944	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		361'717'000	330'638'275	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.06.2023		10'666'000	875'145	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		47'755'000	46'543'456	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		17'133'000	10'136'568	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		18'576'000	21'048'280	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		24'248'000	16'308'477	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.06.2023		31'165'000	3'639'605	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.06.2023		2'633'000	1'776'696	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		32'106'000	4'202'033	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.06.2023		2'072'000	507'184	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.06.2023		480'000	262'968	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		4'402'150'000	28'800'626	JPY/CHF		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		1'566'739	2'355'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		186'512	278'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.07.2023		22'907'000	15'486'277	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.07.2023		1'926'000	464'282	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.07.2023		52'101'000	4'315'005	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.07.2023		508'000	278'460	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.07.2023		4'620'657'000	28'599'094	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.07.2023		17'448'000	19'843'785	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.07.2023		28'415'000	3'243'686	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.07.2023		16'406'000	9'769'445	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.07.2023		31'889'000	4'180'648	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.07.2023		10'161'000	848'444	NOK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.07.2023		363'458'000	325'142'258	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.07.2023		45'394'000	44'303'182	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.07.2023		2'509'000	1'658'750	SGD/CHF		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		4'367'523	52'101'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		330'961'078	363'479'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		831'820	10'161'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		44'560'740	45'808'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		9'838'114	16'672'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		19'829'443	17'555'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		15'360'220	22'907'000	CHF/CAD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		3'308'273	28'415'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		1'688'713	2'509'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		4'166'904	31'889'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.07.2023		470'262	1'926'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.07.2023		277'196	508'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		30'423'372	4'644'350'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.07.2023		97'000	58'933		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		371'000	333'029		USD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		312'867	350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		23'693'000	148'122		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.07.2023		169'000	101'295		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		107'000	122'062		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		414'000	404'528		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		15'981'940	23'701'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.08.2023		519'924	2'162'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		4'333'642	52'414'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.08.2023		275'960	505'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		31'356'122	5'059'120'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		19'938'506	17'579'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		3'243'359	28'481'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		9'932'814	16'716'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		4'069'460	31'080'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		863'132	10'357'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		343'599'978	385'232'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		45'455'174	46'646'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		1'639'030	2'484'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		211'534	217'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		1'505'799	1'682'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		517'000	447'500		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		32'660'000	204'864		JPY/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		434'378	506'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		102'887	93'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.08.2023		52'414'000	4'323'631		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.08.2023		10'357'000	887'388		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.08.2023		2'162'000	511'529		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.08.2023		16'716'000	9'763'816		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.08.2023		505'000	272'427		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.08.2023		46'863'000	44'786'969		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.08.2023		17'672'000	19'708'521		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.08.2023		23'701'000	15'608'057		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.08.2023		31'080'000	3'985'699		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.08.2023		386'903'000	335'371'389		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.08.2023		28'481'000	3'165'606		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.08.2023		5'026'460'000	30'665'427		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.08.2023		2'484'000	1'621'580		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.09.2023		32'017'000	4'117'706		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.09.2023		10'853'000	901'233		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.09.2023		2'319'000	539'283		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.09.2023		48'823'000	46'804'169		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.09.2023		54'759'000	4'417'409		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.09.2023		24'677'000	16'110'873		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.09.2023		407'798'000	360'203'895		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.09.2023		518'000	272'447		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.09.2023		17'516'000	10'020'378		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.09.2023		5'034'554'000	30'545'646		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.09.2023		30'399'000	3'424'143		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.09.2023		18'447'000	20'646'989		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.09.2023		2'769'000	1'811'064		SGD/CHF	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		4'508'035	54'759'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		927'617	10'853'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 05.09.2023		547'231	2'319'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		10'406'576	17'860'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 05.09.2023		278'459	518'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		47'292'700	49'582'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		20'756'441	18'675'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		16'434'927	25'035'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		4'099'072	32'017'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		356'868'564	413'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		3'367'449	30'399'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		31'167'291	5'100'846'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		1'803'962	2'769'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		56'383	59'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		17'314	2'810'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		744'614	853'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		31'035	28'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		16'987	26'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		241'305	276'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		207'043	236'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2023		1'887'000	1'659'584	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.09.2023		527'000	586'448	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.09.2023		139'152'000	842'450	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.09.2023		10'762'000	9'539'889	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 05.09.2023		738'000	479'856	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.09.2023		1'505'000	1'437'371	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 05.09.2023		510'000	288'778	AUD/CHF		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		300'618	271'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		655'681	687'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		5'017'080	5'694'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		422'165	70'050'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		229'358	354'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		94'225	166'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		191'041	218'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		4'290'456	33'408'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.10.2023		489'410	2'109'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		881'454	10'638'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		43'904'479	45'876'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		3'983'020	49'457'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		15'524'893	23'843'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		342'396'802	388'831'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.10.2023		246'987	471'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		9'625'627	16'860'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		29'773'390	4'900'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		19'327'969	17'319'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		1'668'057	2'555'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.10.2023		2'109'000	506'814	ILS/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 03.10.2023		471'000	258'899	NZD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 03.10.2023		26'583'000	3'105'187	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		49'457'000	4'164'774	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		388'831'000	355'722'040	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		17'319'000	19'336'490	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		16'860'000	9'955'527	AUD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 03.10.2023		2'555'000	1'712'540	SGD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		23'843'000	16'133'604	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		33'408'000	4'339'365	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		45'876'000	44'435'494	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		4'900'300'000	30'041'779	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.10.2023		10'638'000	914'442	NOK/CHF		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		2'989'072	26'583'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.11.2023		493'531	2'058'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.11.2023		238'901	436'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		2'697'578	23'152'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		3'938'591	46'864'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		325'995'022	357'484'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		19'296'074	17'335'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		9'253'622	15'705'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		1'630'385	2'437'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		15'059'651	22'318'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		4'125'901	31'817'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		40'809'029	42'215'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		29'434'516	4'793'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		919'562	10'723'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		116'536	174'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		182'849	29'546'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		615'360	670'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		586'684	640'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		122'283	127'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		34'342	31'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		19'169	20'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		44'071	76'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		14'583	2'394'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		24'812	193'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		294'572	326'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		13'234	20'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		34'463	36'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		95'443	106'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		22'458	195'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		202'668	226'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		307'718	344'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	CHF/SGD Verfall 02.11.2023		2'457'000	1'632'136		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.11.2023		42'398'000	40'786'876		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.11.2023		359'796'000	327'450'340		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.11.2023		46'864'000	3'817'541		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.11.2023		23'347'000	2'715'256		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.11.2023		32'010'000	4'125'129		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.11.2023		4'825'640'000	28'999'201		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.11.2023		10'723'000	873'496		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.11.2023		15'781'000	9'093'486		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.11.2023		2'058'000	462'968		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.11.2023		22'492'000	14'745'080		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.11.2023		436'000	230'775		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.11.2023		17'366'000	19'178'316		GBP/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.12.2023		1'605'646	2'422'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.12.2023		39'850'192	41'512'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.12.2023		319'621'202	352'388'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.12.2023		3'729'275	45'879'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.12.2023		2'816'464	24'283'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.12.2023		4'157'580	32'321'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.12.2023		28'091'000	4'667'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.12.2023		872'001	10'731'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.12.2023		8'828'355	15'357'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.12.2023		426'385	1'900'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.12.2023		14'306'566	21'888'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.12.2023		231'598	439'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.12.2023		18'808'525	17'086'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		63'000	36'685		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		800'000	715'809		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		85'000	55'629		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		30'000	33'267		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		23'000'000	138'004		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		65'000	62'552		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.12.2023		1'900'000	443'612		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.12.2023		15'294'000	8'817'450		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.12.2023		32'321'000	4'112'524		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.12.2023		45'879'000	3'806'581		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.12.2023		351'588'000	305'709'282		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.12.2023		17'056'000	18'774'221		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.12.2023		10'731'000	865'562		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.12.2023		41'447'000	39'320'769		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.12.2023		24'283'000	2'703'378		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.12.2023		21'803'000	13'982'264		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.12.2023		2'422'000	1'577'957		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.12.2023		4'644'000'000	27'314'150		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.12.2023		439'000	235'765		NZD/CHF	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.01.2024		511'339	2'196'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		10'029'709	17'441'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		4'676'578	36'822'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		4'228'929	51'066'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		365'483'669	421'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		20'695'295	18'863'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2024		938'345	11'664'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		46'856'570	49'495'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		2'935'070	26'459'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		16'372'807	25'609'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		1'726'745	2'656'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.01.2024		275'104	514'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		50'758	88'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		197'604	307'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		220'733	234'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		2'417'025	2'775'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		121'953	111'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		118'007	933'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		107'374	1'289'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		435'333	396'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		224'964	393'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		208'911	325'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		6'254'622	7'178'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		799'510	848'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2024		80'945	726'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		159'377	183'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		491'596	521'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		80'926	141'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		134'034	122'000		CHF/GBP	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		2'954'928	3'380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		126'011	196'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		224'155	348'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2024		63'913	98'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2024		68'290	815'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		454'237	481'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		166'443	152'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		3'426'229	3'920'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		120'373	209'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2024		146'868	1'158'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		5'965'782	6'895'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2024		274'441	424'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2024		165'837	285'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2024		347'276	316'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2024		711'723	753'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2024		410'150	477'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.01.2024		514'000	273'890		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.01.2024		38'913'000	4'852'840		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.01.2024		27'209'000	17'366'416		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.01.2024		52'332'000	48'650'444		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.01.2024		2'754'000	1'757'107		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.01.2024		18'557'000	10'656'728		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.01.2024		19'960'000	21'415'084		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.01.2024		11'664'000	966'479		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.01.2024		5'684'894'000	33'937'112		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.01.2024		446'658'000	375'911'839		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.01.2024		27'185'000	2'929'999		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.01.2024		2'196'000	513'249		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.01.2024		53'170'000	4'439'695		SEK/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		31'710'066	5'383'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		92'310	15'515'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		598'336	100'539'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		302'085	50'137'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		301'905	49'963'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2024		524'239	85'640'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 02.02.2024		311'315	586'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		5'175'133	41'567'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		18'582'168	29'192'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		51'752'953	55'775'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		1'925'243	3'023'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		11'878'007	20'729'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		22'880'412	21'388'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2024		1'029'034	12'449'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		34'935'529	5'843'635'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		405'996'810	483'901'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		3'261'208	30'334'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 02.02.2024		555'824	2'385'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		4'978'456	59'741'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		1'502'811	1'618'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2024		122'872	1'135'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		686'651	637'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		407'908	716'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		196'953	1'581'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		11'664'426	13'801'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		417'549	658'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		183'900	2'217'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		992'953	168'716'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		898'900	1'058'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		328'155	351'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		207'294	35'354'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		200'890	316'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		2'232'714	2'616'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		330'531	56'437'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		506'431	542'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		216'229	199'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2024		111'096	196'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		4'321'691	5'033'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		178'998	281'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2024		124'314	193'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2024		543'899	578'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2024		182'787	285'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2024		3'866'084	4'460'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2024		379'333	64'823'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2024		121'012	1'465'000		CHF/SEK	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 02.02.2024		415'910	379'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2024		134'394	1'065'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		1'162'000	1'002'434		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		156'000	146'754		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.02.2024		44'213'000	5'527'067		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.02.2024		22'603'000	24'692'647		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.02.2024		63'423'000	5'266'646		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.02.2024		21'641'000	12'272'828		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 02.02.2024		3'216'000	2'064'576		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 02.02.2024		2'385'000	562'383		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.02.2024		31'469'000	3'453'534		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.02.2024		6'168'965'000	36'201'954		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.02.2024		58'708'000	54'707'050		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 02.02.2024		586'000	309'420		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.02.2024		30'732'000	19'733'325		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 02.02.2024		12'449'000	1'021'191		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.02.2024		509'707'000	437'231'762		USD/CHF	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.03.2024		5'620'167	45'037'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		24'207'359	22'228'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.03.2024		5'056'754	61'024'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		12'147'046	21'471'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.03.2024		1'954'111	3'050'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 04.03.2024		598'862	2'546'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.03.2024		3'116'810	28'470'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		38'086'947	6'480'535'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		54'501'462	58'607'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 04.03.2024		324'710	617'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		19'563'264	30'557'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		440'013'436	514'697'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.03.2024		1'051'921	12'857'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		2'347'812	2'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		253'745	271'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.03.2024		324'534	55'016'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		901'956	1'025'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.03.2024		140'668	216'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		179'828	162'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.03.2024		133'125	233'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.03.2024		123'924	130'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.03.2024		762'791	867'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.03.2024		125'791	113'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CHF/SGD Verfall 04.03.2024		3'050'000	1'997'476		SGD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 04.03.2024		22'503'000	25'066'317		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 04.03.2024		2'546'000	627'665		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 04.03.2024		6'535'551'000	38'448'647		JPY/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 04.03.2024		21'704'000	12'445'074		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 04.03.2024		30'773'000	19'979'063		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.03.2024		28'470'000	3'202'192		HKD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 04.03.2024		519'289'000	457'239'157		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 04.03.2024		59'008'000	56'225'773		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NZD Verfall 04.03.2024		617'000	331'021		NZD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 04.03.2024		61'024'000	5'192'532		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 04.03.2024		12'857'000	1'068'288		NOK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 04.03.2024		45'037'000	5'756'629		DKK/CHF	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.04.2024		1'941'926	2'971'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		24'294'146	21'877'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	ILS/CHF Verfall 03.04.2024		669'941	2'724'000		CHF/ILS	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.04.2024		40'182'002	6'820'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		12'292'533	21'488'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		19'565'589	30'221'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.04.2024		3'194'476	28'470'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		458'359'755	522'261'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		56'437'756	59'351'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	NZD/CHF Verfall 03.04.2024		324'069	606'000		CHF/NZD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.04.2024		5'347'286	62'970'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.04.2024		1'037'421	12'517'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.04.2024		6'046'118	47'383'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.04.2024		112'328	117'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.04.2024		75'469	115'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.04.2024		750'359	843'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.04.2024		149'332	132'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.04.2024		113'922	196'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CHF/ILS Verfall 03.04.2024		2'724'000	669'641		ILS/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.04.2024		59'468'000	57'844'524		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/NOK Verfall 03.04.2024		12'517'000	1'039'036		NOK/CHF	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.05.2023	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.04.2024	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
CHF/SEK	Verfall 03.04.2024		62'970'000	5'303'963	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.04.2024		523'104'000	471'133'618	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.04.2024		30'336'000	20'190'125	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 03.04.2024		28'470'000	3'276'612	HKD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.04.2024		21'684'000	12'742'603	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.04.2024		22'009'000	25'040'520	GBP/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.04.2024		6'820'300'000	40'587'605	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 03.04.2024		47'383'000	6'178'743	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 03.04.2024		2'971'000	1'982'697	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 03.04.2024		606'000	326'501	NZD/CHF		0.00	0.00	
ILS/CHF	Verfall 03.05.2024		675'195	2'753'000	CHF/ILS		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		58'385'885	60'153'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 03.05.2024		1'044'020	12'610'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.05.2024		5'426'074	64'560'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		472'575'171	526'474'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.05.2024		20'386'855	30'721'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 03.05.2024		2'972'560	25'890'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 03.05.2024		12'497'315	21'320'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024		25'173'061	22'196'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.05.2024		6'306'969	48'457'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 03.05.2024		2'008'020	3'015'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
NZD/CHF	Verfall 03.05.2024		322'193	600'000	CHF/NZD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		2'092'209	2'317'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		351'242	359'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		1'063'629	1'179'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2024		205'744	180'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		161'999	167'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2024		184'511	189'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2024		179'893	197'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CHF/CAD	Verfall 03.05.2024		30'721'000	20'509'647	CAD/CHF		0.00	0.00	
CHF/NOK	Verfall 03.05.2024		12'610'000	1'044'234	NOK/CHF		0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.05.2024		530'167'000	486'269'172	USD/CHF		0.00	0.00	
CHF/HKD	Verfall 03.05.2024		25'890'000	3'035'836	HKD/CHF		0.00	0.00	
CHF/JPY	Verfall 03.05.2024		7'076'421'000	41'244'920	JPY/CHF		0.00	0.00	
CHF/NZD	Verfall 03.05.2024		600'000	325'632	NZD/CHF		0.00	0.00	
CHF/DKK	Verfall 03.05.2024		48'457'000	6'371'611	DKK/CHF		0.00	0.00	
CHF/SEK	Verfall 03.05.2024		64'560'000	5'395'279	SEK/CHF		0.00	0.00	
CHF/EUR	Verfall 03.05.2024		60'868'000	59'696'291	EUR/CHF		0.00	0.00	
CHF/ILS	Verfall 03.05.2024		2'753'000	676'522	ILS/CHF		0.00	0.00	
CHF/SGD	Verfall 03.05.2024		3'015'000	2'027'557	SGD/CHF		0.00	0.00	
CHF/AUD	Verfall 03.05.2024		21'320'000	12'697'766	AUD/CHF		0.00	0.00	
CHF/GBP	Verfall 03.05.2024		22'376'000	25'695'256	GBP/CHF		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.05.2024		41'310'382	6'932'284'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.05.2024		664'818	111'275'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 07.05.2024		193'804	32'862'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 03.06.2024		20'293'113	30'489'000	CHF/CAD		0.00	0.00	b)
NOK/CHF	Verfall 03.06.2024		1'057'514	12'805'000	CHF/NOK		0.00	0.00	b)
USD/CHF	Verfall 03.06.2024		468'475'005	512'562'000	CHF/USD		-0.01	0.00	b)
HKD/CHF	Verfall 03.06.2024		3'174'466	27'141'000	CHF/HKD		0.00	0.00	b)
JPY/CHF	Verfall 03.06.2024		38'768'638	6'644'803'000	CHF/JPY		0.00	0.00	b)
DKK/CHF	Verfall 03.06.2024		6'251'451	47'637'000	CHF/DKK		0.00	0.00	b)
SEK/CHF	Verfall 03.06.2024		5'260'868	63'086'000	CHF/SEK		0.00	0.00	b)
EUR/CHF	Verfall 03.06.2024		58'170'495	59'447'000	CHF/EUR		0.00	0.00	b)
ILS/CHF	Verfall 03.06.2024		644'283	2'628'000	CHF/ILS		0.00	0.00	b)
SGD/CHF	Verfall 03.06.2024		2'073'680	3'090'000	CHF/SGD		0.00	0.00	b)
AUD/CHF	Verfall 03.06.2024		12'196'276	20'531'000	CHF/AUD		0.00	0.00	b)
GBP/CHF	Verfall 03.06.2024		26'071'203	22'779'000	CHF/GBP		0.00	0.00	b)
NZD/CHF	Verfall 04.06.2024		324'459	600'000	CHF/NZD		0.00	0.00	b)
Devisentermingeschäfte auf Klassen							-0.01	0.00	

Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	10'515'788.59	0.46
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	75'454'939.04	3.30
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	2'196'444'568.06	96.10
Derivative Finanzinstrumente	-0.01	0.00
Sonstige Vermögenswerte	3'218'888.68	0.14
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'285'634'184.36	100.00
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-11'449'494.48	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	2'274'184'689.88	

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);	2'271'899'507.10	99.40
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-0.01	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

AUD	1 = CHF	0.5955135
CAD	1 = CHF	0.66757652
DKK	100 = CHF	13.14844400
EUR	1 = CHF	0.98066786
GBP	1 = CHF	1.14840937
HKD	100 = CHF	11.72646100
ILS	1 = CHF	0.24572332
JPY	100 = CHF	0.58281700
NOK	100 = CHF	8.28190000
NZD	1 = CHF	0.54272351
SEK	100 = CHF	8.35603500
SGD	1 = CHF	0.67252062
USD	1 = CHF	0.91715000

4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	14'571'346.01	0.641
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	644'689'336.70	28.348

5 Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung

Periode: 01.05.2023 - 30.04.2024

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
NT CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.061	0.00 - 0.04	-	0.019
NTH1 CHF	CHF	0.00 - 0.08	-	0.061	0.00 - 0.04	-	0.019

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. 1 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: 01.05.2023 - 30.04.2024

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %		PAF p.a. in %		VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max	Eff	Max	Eff	Max	Eff	Max
NT CHF	-	-	-	-	-	-	-	3.000
NTH1 CHF	-	-	-	-	-	-	-	3.000

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

MSCI World ex Switzerland Index TR Net

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 2023 / 2024

Ex-Datum: 20.08.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 23.08.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF 34)	Nein	CHF	5.363	-	5.363
NTH1 CHF 34)	Nein	CHF	3.753	-	3.753

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.
- 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.
- 33) Annualisierte Standardabweichung der monatlichen Renditedifferenz zwischen stetiger Bruttorendite (vor Abzug von Gebühren) und stetiger Benchmarkrendite über den Betrachtungszeitraum.
Berechnungsformel: Tracking Error = STANDARDABWEICHUNG (über einen Zwölfmonatszeitraum berechnete monatliche Renditedifferenz) * QUADRATWURZEL(12)
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.
- 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 für die in § 17 Ziff. 2 Bst. a genannten Teilvermögen und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) bzw. der Bewertungs-Nettoinventarwert für das in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannte Teilvermögen 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 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. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an 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 Marktrendite 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.
5. 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.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines der in § 17 Ziff. 2 Bst. a genannten Teilvermögen bzw. der Bewertungs-Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse für das in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannte Teilvermögen ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens des jeweiligen Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des entsprechenden Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Der Nettoinventarwert wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse oder der jeweiliger weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Anhang) gerundet. Bei Teilvermögen mit der Rechnungseinheit japanischer Yen (JPY) wird der Nettoinventarwert auf 0.01 der Rechnungseinheit des Teilvermögens oder, falls abweichend, auf 0.0001 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- oder Rücknahmewährung (gemäss angehängter Tabelle) gerundet.
7. Falls an einem Auftragstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen in bar des in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannten Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Bewertungs-Nettoinventarwert erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Bewertungs-Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld-/Brief-Spannen, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.), die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten

Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Erhöhung des Nettovermögens des in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannten Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Bewertungs-Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang des Nettovermögens des in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannten Teilvermögens bewirken. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing beim in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannten Teilvermögen ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss dem 1. Satz dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert. Der modifizierte Nettoinventarwert wird auf 0.0001 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Tabelle im Anhang) gerundet.

Der beim in § 17 Ziff. 2 Bst. b genannten Teilvermögen bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen in bar anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Bewertungs-Nettoinventarwert bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einem Durchschnittswert aus einer im Anhang zum Fondsvertrag (Ziff. VIII) näher definierten Periode

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Situationen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, die maximal zulässige Anpassung des Bewertungs-Nettoinventarwertes vorübergehend überschritten werden. Der entsprechend hinreichend begründete Entscheid der Fondsleitung wird zur Information der bestehenden und neuen Anleger im Publikationsorgan, welches im Anhang zum Fondsvertrag genannt ist, veröffentlicht und der Prüfgesellschaft sowie der FINMA mitgeteilt.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen dieses 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 Betreffnisse 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 Inventarberechnung, 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 Nettofondsvermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.