

# Jahresbericht 2022/2023

Geprüfter Jahresbericht  
per 31. Oktober 2023



**Anlagefonds schweizerischen Rechts**

UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF)



# Inhaltsverzeichnis

|   |    |
|---|----|
| Anlagekategorie und ISIN                                      | 2  |
| Organisation  | 3  |
| UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF)                          | 4  |
| Anhang zu Ergänzende Angaben                                  | 14 |
| Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft | 16 |
| Sonstige Informationen  | 18 |

## Verkaufsrestriktionen

Anteile dieses Anlagefonds dürfen innerhalb der USA weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Anlegern, die US Persons sind, dürfen keine Anteile dieses Anlagefonds angeboten, verkauft oder ausgeliefert werden.

Eine US Person ist eine Person, die:

- (i) eine United States Person im Sinne von Paragraph 7701(a)(30) des US Internal Revenue Code von 1986 in der geltenden Fassung sowie der in dessen Rahmen erlassenen Treasury Regulations ist;
- (ii) eine US Person im Sinne von Regulation S des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (17 CFR § 230.902(k)) ist;
- (iii) keine Non-United States Person im Sinne von Rule 4.7 der US Commodity Futures Trading Commission Regulations (17 CFR § 4.7(a)(1)(iv)) ist;
- (iv) sich im Sinne von Rule 202(a)(30)-1 des US Investment Advisers Act von 1940 in der geltenden Fassung in den Vereinigten Staaten aufhält; oder
- (v) ein Trust, eine Rechtseinheit oder andere Struktur ist, die zu dem Zweck gegründet wurde, dass US Persons in diesen Anlagefonds investieren können.

# Anlagekategorie und ISIN

UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF)

## **Fund Switzerland (CHF)**

|      |              |
|------|--------------|
| F    | CH0212694449 |
| I-A1 | CH0205516401 |
| P    | CH0002788807 |
| Q    | CH0203277022 |

# Organisation

## Fondsleitung

UBS Fund Management (Switzerland) AG  
Aeschenvorstadt 1, 4002 Basel

## Verwaltungsrat

*Michael Kehl*

Präsident

Managing Director, UBS Asset Management  
Switzerland AG, Zürich

*Dr. Daniel Brüllmann*

Vizepräsident

Managing Director, UBS Asset Management  
Switzerland AG, Zürich

*Francesca Gigli Prym*

Mitglied

Managing Director, UBS Fund Management  
(Luxembourg) S.A., Luxemburg

*Dr. Michèle Sennhauser*

Mitglied

Executive Director, UBS Asset Management  
Switzerland AG, Zürich

*Franz Gysin*

Unabhängiges Mitglied

*Werner Strebel*

Unabhängiges Mitglied

## Geschäftsleitung

*Eugène Del Cioppo*

CEO

*Georg Pfister*

Stellvertretender CEO sowie Operating Office  
Finance, HR

*Urs Fäs*

Real Estate Fund

*Christel Müller*

Business Risk Management

*Thomas Reisser*

Compliance & Operational Risk Control

*Matthias Börlin*

Admin, Custody & Tax Oversight

*Daniel Diaz*

Delegation & Investment Risk Management

*Melanie Gut*

Corporate & Regulatory Governance

*Patric Schläpfer*

Corporate Services

*Hubert Zeller*

White Labelling Solutions Schweiz

## Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Basel

## Übertragung der Anlageentscheide

UBS Asset Management Switzerland AG, Zürich

## Übertragung der Anlageentscheide

Die Administration des Anlagefonds, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel, übertragen. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen den Parteien abgeschlossenen Vertrag geregelt. Alle anderen Aufgaben der Fondsleitung wie auch die Kontrolle der übertragenen weiteren Aufgaben werden in der Schweiz ausgeführt.

## Zahlstellen

UBS Switzerland AG, Zürich  
und ihre Geschäftsstellen in der Schweiz

## Vertrieb Singapur

Der Anlagefonds wurde von der Monetary Authority of Singapore (MAS), zum ausschliesslichen Vertrieb im institutionellen Rahmen an akkreditierte Anleger und andere Anleger im Sinne der Sektion 305 des 'Securities and Futures Act' und des Sechsten Verzeichnisses der 'Securities and Futures (Offers of Investments) (Collective Investment Schemes) Regulation' in Singapur zugelassen.

# UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

## Dreijahresvergleich

|  | ISIN                | 31.10.2023     | 31.10.2022     | 31.10.2021       |
|--|---------------------|----------------|----------------|------------------|
| Nettofondsvermögen in CHF                                  |                     | 835 866 344.30 | 865 647 742.44 | 1 011 694 364.53 |
| <b>Klasse F</b>  | <b>CH0212694449</b> |                |                |                  |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF                        |                     | 7 878.99       | 8 203.37       | 9 483.46         |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF <sup>1</sup> |                     | 7 878.20       | 8 202.55       | 9 482.51         |
| Anzahl Anteile im Umlauf                                   |                     | 12 975,8190    | 13 306,3690    | 14 393,1170      |
| <b>Klasse I-A1</b>   | <b>CH0205516401</b> |                |                |                  |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF                        |                     | 130.08         | 135.43         | 156.58           |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF <sup>1</sup> |                     | 130.07         | 135.42         | 156.56           |
| Anzahl Anteile im Umlauf                                   |                     | 15 338,4200    | 20 498,4200    | 20 358,4200      |
| <b>Klasse P</b>  | <b>CH0002788807</b> |                |                |                  |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF                        |                     | 7 841.65       | 8 164.13       | 9 438.86         |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF <sup>1</sup> |                     | 7 840.87       | 8 163.31       | 9 437.92         |
| Anzahl Anteile im Umlauf                                   |                     | 84 031,7170    | 83 510,3250    | 83 160,8900      |
| <b>Klasse Q</b>  | <b>CH0203277022</b> |                |                |                  |
| Nettoinventarwert pro Anteil in CHF                        |                     | 123.86         | 128.96         | 149.09           |
| Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF <sup>1</sup> |                     | 123.85         | 128.95         | 149.08           |
| Anzahl Anteile im Umlauf                                   |                     | 586 838,3430   | 557 725,6400   | 583 991,8250     |

<sup>1</sup> siehe Ergänzende Angaben

## Performance

|                   | Währung | 2022/2023 | 2021/2022 | 2020/2021 |
|-------------------|---------|-----------|-----------|-----------|
| Klasse F          | CHF     | -1.5%     | -11.7%    | 30.0%     |
| Klasse I-A1       | CHF     | -1.6%     | -11.7%    | 29.9%     |
| Klasse P          | CHF     | -1.6%     | -11.8%    | 29.8%     |
| Klasse Q          | CHF     | -1.6%     | -11.8%    | 29.9%     |
| Benchmark:        |         |           |           |           |
| UBS 100 Index (r) | CHF     | -1.4%     | -11.6%    | 30.2%     |

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 Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

## Struktur des Wertpapierportfolios

### Die 10 grössten Emittenten in % des Gesamtfondsvermögens

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| Nestlé SA              | 19,08        |
| Novartis AG            | 13,03        |
| Roche Holding AG       | 12,49        |
| UBS AG                 | 4,74         |
| Zürich Insurance Group | 4,59         |
| Cie Financiere Riche   | 4,06         |
| ABB Ltd                | 3,58         |
| Sika AG                | 2,44         |
| Alcon AG               | 2,36         |
| Holcim Ltd             | 2,17         |
| Übrige                 | 30,68        |
| <b>TOTAL</b>           | <b>99,22</b> |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

### Aufteilung nach Branchen in % des Gesamtfondsvermögens

|  |              |
|--|--------------|
| Pharmazeutik, Kosmetik & medizinische Produkte | 27,73        |
| Nahrungsmittel & Softdrinks                    | 21,21        |
| Finanz- & Beteiligungsgesellschaften           | 12,00        |
| Versicherungen                                 | 8,68         |
| Chemie   | 6,69         |
| Uhren & Schmuck                                | 4,73         |
| Elektrische Geräte & Komponenten               | 4,03         |
| Baugewerbe & Baumaterial                       | 3,25         |
| Banken & Kreditinstitute                       | 1,94         |
| Maschinen & Apparate                           | 1,53         |
| Übrige   | 7,43         |
| <b>TOTAL</b>                                   | <b>99,22</b> |

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

## Vermögensrechnung

|   | 31.10.2023            | 31.10.2022            |
|---|-----------------------|-----------------------|
| Verkehrswerte                           | CHF                   | CHF                   |
| Bankguthaben                            |                       |                       |
| – auf Sicht                             | 3 544 956.73          | 197 845.04            |
| Effekten                                |                       |                       |
| – Aktien und andere Beteiligungspapiere | 832 206 690.91        | 865 505 280.92        |
| Derivative Finanzinstrumente            | -6 560.00             | -1 180.00             |
| Sonstige Vermögenswerte                 | 3 029 268.59          | 2 654 644.92          |
| <b>Gesamtfondsvermögen</b>              | <b>838 774 356.23</b> | <b>868 356 590.88</b> |
| Aufgenommene Kredite                    | -2 731 320.34         | -2 541 428.69         |
| Andere Verbindlichkeiten                | -176 691.59           | -167 419.75           |
| <b>Nettofondsvermögen</b>               | <b>835 866 344.30</b> | <b>865 647 742.44</b> |

## Erfolgsrechnung

|   | 1.11.2022-31.10.2023  | 1.11.2021-31.10.2022   |
|---|-----------------------|------------------------|
| Ertrag  | CHF                   | CHF                    |
| Erträge der Bankguthaben  | 251.46                | 0.00                   |
| Negativzinsen   | -154.51               | -1 043.91              |
| Erträge der Effekten  |                       |                        |
| – aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren                         | 25 478 172.42         | 23 660 264.19          |
| – aus Gratisaktien  | 0.00                  | 749.01                 |
| Ausgleichszahlungen aus Securities Lending                            | 18 081.49             | 93 054.37              |
| Erträge der Effektenleihe   | 62 647.43             | 73 483.07              |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen         | 915 853.85            | 983 096.92             |
| <b>TOTAL Ertrag</b>   | <b>26 474 852.14</b>  | <b>24 809 603.65</b>   |
| <b>Aufwand</b>  |                       |                        |
| Passivzinsen  | -111 577.38           | -62 455.24             |
| Prüfaufwand   | -18 669.80            | -18 669.80             |
| Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse F    | -181 815.75           | -193 334.51            |
| Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1 | -4 289.08             | -5 685.51              |
| Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse P    | -1 824 153.77         | -1 913 619.32          |
| Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse Q    | -159 177.28           | -168 954.02            |
| Sonstige Aufwendungen   | -85 357.62            | -73 324.96             |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen     | -1 056 356.36         | -1 013 707.50          |
| <b>TOTAL Aufwand</b>  | <b>-3 441 397.04</b>  | <b>-3 449 750.86</b>   |
| <b>Nettoertrag</b>  | <b>23 033 455.10</b>  | <b>21 359 852.79</b>   |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste <sup>1</sup>                 | 11 172 769.74         | 25 364 497.53          |
| <b>Realisierter Erfolg</b>  | <b>34 206 224.84</b>  | <b>46 724 350.32</b>   |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste                        | -47 105 739.66        | -162 182 610.19        |
| <b>Gesamterfolg</b>   | <b>-12 899 514.82</b> | <b>-115 458 259.87</b> |

<sup>1</sup> Realisierte Kapitalgewinne und -verluste können Aufwendungen und Erträge aus Swinging Single Pricing enthalten.

## Verwendung des Erfolges

|  | 1.11.2022-31.10.2023 | 1.11.2021-31.10.2022 |
|--|----------------------|----------------------|
|  | CHF                  | CHF                  |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres                                      | 23 033 455.10        | 21 359 852.79        |
| Vortrag des Vorjahres  | 3 085.86             | 4 491.77             |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>                             | <b>23 036 540.96</b> | <b>21 364 344.56</b> |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg | -23 035 051.90       | -21 361 258.70       |
| <b>Vortrag auf neue Rechnung</b>                                     | <b>1 489.06</b>      | <b>3 085.86</b>      |

## Veränderung des Nettofondsvermögens

|   | 1.11.2022-31.10.2023  | 1.11.2021-31.10.2022  |
|---|-----------------------|-----------------------|
|   | CHF                   | CHF                   |
| Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres      | 865 647 742.44        | 1 011 694 364.53      |
| Ordentliche Jahresausschüttung                        | -21 404 623.08        | -20 237 799.14        |
| Saldo aus dem Anteilverkehr                           | 4 522 739.76          | -10 350 563.08        |
| Gesamterfolg  | -12 899 514.82        | -115 458 259.87       |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>835 866 344.30</b> | <b>865 647 742.44</b> |

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

|   | 1.11.2022-31.10.2023 | 1.11.2021-31.10.2022 |
|---|----------------------|----------------------|
| <b>Klasse F</b>   | <b>Anzahl</b>        | <b>Anzahl</b>        |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr                                      | 13 306,3690          | 14 393,1170          |
| Ausgegebene Anteile   | 2 151,8600           | 2 741,2910           |
| Zurückgenommene Anteile   | -2 482,4100          | -3 828,0390          |
| <b>Bestand Ende Berichtsperiode</b>                               | <b>12 975,8190</b>   | <b>13 306,3690</b>   |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -330,5500            | -1 086,7480          |
| <b>Klasse I-A1</b>  | <b>Anzahl</b>        | <b>Anzahl</b>        |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr                                      | 20 498,4200          | 20 358,4200          |
| Ausgegebene Anteile   | 140,0000             | 140,0000             |
| Zurückgenommene Anteile   | -5 300,0000          | 0,0000               |
| <b>Bestand Ende Berichtsperiode</b>                               | <b>15 338,4200</b>   | <b>20 498,4200</b>   |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | -5 160,0000          | 140,0000             |
| <b>Klasse P</b>   | <b>Anzahl</b>        | <b>Anzahl</b>        |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr                                      | 83 510,3250          | 83 160,8900          |
| Ausgegebene Anteile   | 5 377,5630           | 5 565,0370           |
| Zurückgenommene Anteile   | -4 856,1710          | -5 215,6020          |
| <b>Bestand Ende Berichtsperiode</b>                               | <b>84 031,7170</b>   | <b>83 510,3250</b>   |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 521,3920             | 349,4350             |
| <b>Klasse Q</b>   | <b>Anzahl</b>        | <b>Anzahl</b>        |
| Bestand Anfang Rechnungsjahr                                      | 557 725,6400         | 583 991,8250         |
| Ausgegebene Anteile   | 73 402,6710          | 52 156,6700          |
| Zurückgenommene Anteile   | -44 289,9680         | -78 422,8550         |
| <b>Bestand Ende Berichtsperiode</b>                               | <b>586 838,3430</b>  | <b>557 725,6400</b>  |
| Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen | 29 112,7030          | -26 266,1850         |

## Ausschüttung für 2022/2023

### Klasse F

Gegen Coupon Nr. 11 - Ex-Datum 10.1.2024)

|  |            |               |
|--|------------|---------------|
| <b>Aufgelaufener Ertrag pro Anteil</b> | <b>CHF</b> | <b>224.02</b> |
|--|------------|---------------|

|               |            |               |
|---------------|------------|---------------|
| <b>Brutto</b> | <b>CHF</b> | <b>224.02</b> |
|---------------|------------|---------------|

|                                    |     |        |
|------------------------------------|-----|--------|
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -78.41 |
|------------------------------------|-----|--------|

|  |            |               |
|--|------------|---------------|
| <b>Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.1.2024)</b> | <b>CHF</b> | <b>145.61</b> |
|--|------------|---------------|

### Klasse I-A1

Gegen Coupon Nr. 10 - Ex-Datum 10.1.2024)

|  |            |              |
|--|------------|--------------|
| <b>Aufgelaufener Ertrag pro Anteil</b> | <b>CHF</b> | <b>3.666</b> |
|--|------------|--------------|

|               |            |              |
|---------------|------------|--------------|
| <b>Brutto</b> | <b>CHF</b> | <b>3.660</b> |
|---------------|------------|--------------|

|                                    |     |        |
|------------------------------------|-----|--------|
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -1.281 |
|------------------------------------|-----|--------|

|  |            |              |
|--|------------|--------------|
| <b>Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.1.2024)</b> | <b>CHF</b> | <b>2.379</b> |
|--|------------|--------------|

### Klasse P

Gegen Coupon Nr. 35 - Ex-Datum 10.1.2024)

|  |            |               |
|--|------------|---------------|
| <b>Aufgelaufener Ertrag pro Anteil</b> | <b>CHF</b> | <b>214.71</b> |
|--|------------|---------------|

|               |            |               |
|---------------|------------|---------------|
| <b>Brutto</b> | <b>CHF</b> | <b>214.70</b> |
|---------------|------------|---------------|

|                                    |     |        |
|------------------------------------|-----|--------|
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -75.15 |
|------------------------------------|-----|--------|

|  |            |               |
|--|------------|---------------|
| <b>Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.1.2024)</b> | <b>CHF</b> | <b>139.55</b> |
|--|------------|---------------|

### Klasse Q

Gegen Coupon Nr. 8 - Ex-Datum 10.1.2024)

|  |            |              |
|--|------------|--------------|
| <b>Aufgelaufener Ertrag pro Anteil</b> | <b>CHF</b> | <b>3.462</b> |
|--|------------|--------------|

|               |            |              |
|---------------|------------|--------------|
| <b>Brutto</b> | <b>CHF</b> | <b>3.460</b> |
|---------------|------------|--------------|

|                                    |     |        |
|------------------------------------|-----|--------|
| Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer | CHF | -1.211 |
|------------------------------------|-----|--------|

|  |            |              |
|--|------------|--------------|
| <b>Netto pro Anteil (zahlbar ab 12.1.2024)</b> | <b>CHF</b> | <b>2.249</b> |
|--|------------|--------------|

# Inventar des Fondsvermögens

## Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

| Titel  |     | 31.10.2022         |                    | 31.10.2023            |                    | Verkehrswert <sup>3</sup><br>in CHF | in % <sup>3</sup> | Davon<br>ausgeliehen<br>Anzahl/<br>Nominal |
|--|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
|  |     | Anzahl/<br>Nominal | Käufe <sup>1</sup> | Verkäufe <sup>2</sup> | Anzahl/<br>Nominal |                                     |                   |  |
| <b>Inhaberaktien</b>                           |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| <b>Österreich</b>                              |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| AMS AG NPV (BR)*                               | CHF | 161 829            | 26 834             | 20 948                | 167 715            | 541 552                             | 0,06              | 167 715                                    |
| <b>TOTAL Österreich</b>                        |     |                    |                    |                       |                    | <b>541 552</b>                      | <b>0,06</b>       |  |
| <b>Schweiz</b>                                 |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| COMET HOLDINGS CHF1 (REGD)*                    | CHF | 4 550              | 184                |                       | 4 734              | 843 125                             | 0,10              |  |
| DAETWYLER HLDG CHF0.05 (POST SUBDIVISION)*     | CHF | 4 463              |                    |                       | 4 463              | 713 187                             | 0,09              |  |
| GALENICA AG CHF0.1*                            | CHF | 29 367             | 2 620              | 1 487                 | 30 500             | 2 090 775                           | 0,25              |  |
| IDORSIA AG CHF0.05*                            | CHF | 64 572             | 7 403              | 71 975                |                    |                                     |                   |  |
| LANDIS & GYR GROUP CHF10 (REGD)*               | CHF | 13 075             | 750                | 575                   | 13 250             | 890 400                             | 0,11              |  |
| ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)*                       | CHF | 15 975             | 2 392              | 447                   | 17 920             | 4 429 824                           | 0,53              |  |
| SENSIRION AG NPV*                              | CHF | 6 000              | 510                |                       | 6 510              | 442 680                             | 0,05              |  |
| SKAN GROUP AG CHF0.01 (REGD)*                  | CHF |                    | 7 250              |                       | 7 250              | 493 725                             | 0,06              |  |
| SWATCH GROUP CHF2.25(BR)*                      | CHF | 17 382             | 849                | 481                   | 17 750             | 4 121 550                           | 0,49              |  |
| SWISS RE AG CHF0.10*                           | CHF | 173 761            | 11 172             | 7 658                 | 177 275            | 17 571 498                          | 2,09              |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>                           |     |                    |                    |                       |                    | <b>31 596 765</b>                   | <b>3,77</b>       |  |
| <b>Total Inhaberaktien</b>                     |     |                    |                    |                       |                    | <b>32 138 317</b>                   | <b>3,83</b>       |  |
| <b>Partizipationsscheine</b>                   |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| <b>Schweiz</b>                                 |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| GRAUBÜNDNER KTBK PTG CHF100*                   | CHF | 445                | 74                 | 79                    | 440                | 726 000                             | 0,09              |  |
| LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10*              | CHF | 629                | 34                 | 43                    | 620                | 6 231 000                           | 0,74              |  |
| SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)* | CHF | 24 377             | 1 768              | 1 085                 | 25 060             | 4 590 992                           | 0,55              |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>                           |     |                    |                    |                       |                    | <b>11 547 992</b>                   | <b>1,38</b>       |  |
| <b>Total Partizipationsscheine</b>             |     |                    |                    |                       |                    | <b>11 547 992</b>                   | <b>1,38</b>       |  |
| <b>Weitere Aktien</b>                          |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| <b>Schweiz</b>                                 |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV*              | CHF | 420 331            | 32 521             | 23 792                | 429 060            | 100 335 681                         | 11,96             |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>                           |     |                    |                    |                       |                    | <b>100 335 681</b>                  | <b>11,96</b>      |  |
| <b>Total Weitere Aktien</b>                    |     |                    |                    |                       |                    | <b>100 335 681</b>                  | <b>11,96</b>      |  |
| <b>Namensaktien</b>                            |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| <b>Nordamerika</b>                             |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| BB BIOTECH AG CHF0.20 (REGD)*                  | CHF | 32 324             | 1 743              | 767                   | 33 300             | 1 210 455                           | 0,14              |  |
| <b>TOTAL Nordamerika</b>                       |     |                    |                    |                       |                    | <b>1 210 455</b>                    | <b>0,14</b>       |  |
| <b>Schweiz</b>                                 |     |                    |                    |                       |                    |                                     |                   |  |
| ABB LTD CHF0.12 (REGD)*                        | CHF | 974 000            | 95 319             | 82 637                | 986 682            | 30 034 600                          | 3,58              |  |
| ACCELLERON INDUSTRI CHF1*                      | CHF | 48 700             | 11 885             | 3 585                 | 57 000             | 1 273 380                           | 0,15              |  |
| ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*                 | CHF | 102 098            | 10 702             | 9 849                 | 102 951            | 3 525 042                           | 0,42              |  |
| ALCON AG CHF0.04*                              | CHF | 298 970            | 20 000             | 13 818                | 305 152            | 19 779 953                          | 2,36              |  |
| ALLREAL HOLDING AG CHF1*                       | CHF | 9 100              | 821                | 521                   | 9 400              | 1 370 520                           | 0,16              |  |
| ALSO HOLDING AG CHF1.00 (REGD)*                | CHF | 3 639              | 240                |                       | 3 879              | 896 049                             | 0,11              |  |
| ARBONIA AG CHF4.20 (REGD)*                     | CHF | 30 719             |                    | 30 719                |                    |                                     |                   |  |
| ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)*                      | CHF | 558 679            | 49 445             |                       | 608 124            | 1 011 310                           | 0,12              |  |
| BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)*       | CHF | 18 140             | 1 160              |                       | 19 300             | 1 266 080                           | 0,15              | 19 299                                     |
| BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)*                    | CHF | 27 301             | 1 915              | 1 192                 | 28 024             | 3 648 725                           | 0,44              |  |
| BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)*             | CHF | 2 123              | 117                | 48                    | 2 192              | 3 014 000                           | 0,36              |  |
| BELIMO HOLDING AG CHF0.05*                     | CHF | 5 813              | 422                | 185                   | 6 050              | 2 305 050                           | 0,27              |  |
| BERNER KTBK CHF20 (REGD)*                      | CHF | 2 628              | 139                |                       | 2 767              | 658 546                             | 0,08              |  |
| BKW AG CHF2.5*                                 | CHF | 11 390             | 1 033              | 323                   | 12 100             | 1 846 460                           | 0,22              |  |
| BOSSARD HLDGS AG CHF5*                         | CHF | 3 139              | 444                |                       | 3 583              | 670 738                             | 0,08              |  |

| Titel   |     | 31.10.2022         |                    | 31.10.2023            |                    | Verkehrswert <sup>3</sup><br>in CHF | in % <sup>3</sup> | Davon<br>ausgeliehen<br>Anzahl/<br>Nominal |
|---|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
|   |     | Anzahl/<br>Nominal | Käufe <sup>1</sup> | Verkäufe <sup>2</sup> | Anzahl/<br>Nominal |                                     |                   |  |
| BQE CANT VAUDOISE CHF1*                       | CHF | 16 827             | 1 962              | 1 179                 | 17 610             | 1 806 786                           | 0,22              |  |
| BUCHER INDUSTRIES CHF0.20 (REGD)*             | CHF | 4 069              | 225                | 169                   | 4 125              | 1 334 025                           | 0,16              |  |
| BURCKHARDT COMPRES CHF2.5*                    | CHF | 1 787              |                    | 47                    | 1 740              | 800 400                             | 0,10              |  |
| CEMBRA MONEY BANK CHF1.00 (REGD)*             | CHF | 17 614             | 824                |                       | 18 438             | 1 151 453                           | 0,14              |  |
| CLARIANT CHF4.00(REGD)*                       | CHF | 133 067            | 21 247             | 14 464                | 139 850            | 1 799 870                           | 0,21              |  |
| CONZZETA AG CHF2 (REGD) 'A'*                  | CHF | 877                |                    |                       | 877                | 380 618                             | 0,05              |  |
| CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)*              | CHF | 1 518 149          | 802 543            | 2 320 692             |                    |                                     |                   |  |
| DKSH HOLDING LTD CHF0.1*                      | CHF | 21 140             | 1 275              | 615                   | 21 800             | 1 214 260                           | 0,14              |  |
| DOCMORRIS AG CHF30.00*                        | CHF | 5 925              | 2 194              | 8 119                 |                    |                                     |                   |  |
| DORMAKABA HOLDING CHF0.10 'B'(REGD)*          | CHF | 1 791              |                    |                       | 1 791              | 741 474                             | 0,09              |  |
| DOTTIKON ES HLDG CHF0.01*                     | CHF |                    | 1 850              |                       | 1 850              | 370 000                             | 0,04              |  |
| DUFFRY AG CHF5 (REGD)*                        | CHF | 40 143             | 25 786             | 1 078                 | 64 851             | 2 056 425                           | 0,25              |  |
| EFG INTERNATIONAL CHF0.50 (REGD)*             | CHF |                    | 65 300             |                       | 65 300             | 710 464                             | 0,08              |  |
| EMMI AG CHF10 (REGD)*                         | CHF | 1 248              |                    |                       | 1 248              | 1 070 784                           | 0,13              |  |
| EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)* | CHF | 4 108              | 226                | 184                   | 4 150              | 2 573 000                           | 0,31              |  |
| FLUGHAFEN ZURICH A CHF10(REGD) POST SPLIT*    | CHF | 11 523             | 747                | 599                   | 11 671             | 1 974 733                           | 0,24              | 11 670                                     |
| FORBO HLDGS AG CHF0.10(REGD)*                 | CHF | 651                |                    |                       | 651                | 651 000                             | 0,08              |  |
| GEBERIT CHF0.10(REGD)*                        | CHF | 21 476             | 2 066              | 2 069                 | 21 473             | 9 057 311                           | 1,08              |  |
| GEORG FISCHER AG CHF0.05 (REGD) (POST SPLIT)* | CHF | 49 020             | 2 679              | 1 649                 | 50 050             | 2 348 346                           | 0,28              |  |
| GIVAUDAN AG CHF10*                            | CHF | 4 764              | 292                | 180                   | 4 876              | 14 725 520                          | 1,76              |  |
| HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD*    | CHF | 21 034             | 1 149              | 783                   | 21 400             | 2 606 520                           | 0,31              |  |
| HOLCIM LTD CHF2 (REGD)*                       | CHF | 338 379            | 16 936             | 31 272                | 324 043            | 18 172 331                          | 2,17              |  |
| HUBER & SUHNER AG CHF0.25*                    | CHF | 10 210             |                    |                       | 10 210             | 634 041                             | 0,08              |  |
| INFICON HOLDING AG CHF5(REGD)*                | CHF | 1 044              |                    |                       | 1 044              | 1 028 340                           | 0,12              |  |
| INTERROLL HLDG AG CHF1 (REGD)*                | CHF | 398                | 53                 |                       | 451                | 1 075 635                           | 0,13              |  |
| INTERSHOP HLDG AG CHF10(REG)*                 | CHF |                    | 625                |                       | 625                | 376 875                             | 0,04              |  |
| JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*            | CHF | 127 785            | 6 519              | 7 804                 | 126 500            | 6 780 400                           | 0,81              |  |
| KARDEX HOLDING AG CHF0.45 (REGD)*             | CHF | 3 443              | 246                |                       | 3 689              | 647 051                             | 0,08              |  |
| KOMAX CHF0.10(REGD)*                          | CHF | 2 150              | 191                |                       | 2 341              | 420 912                             | 0,05              | 2 149                                      |
| KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)*      | CHF | 33 951             | 2 282              | 2 133                 | 34 100             | 8 337 450                           | 0,99              | 34 099                                     |
| LEM HLDGS AG CHF0.50(REGD)(POST SUBD)*        | CHF | 328                |                    |                       | 328                | 603 520                             | 0,07              |  |
| LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)*               | CHF | 64                 | 4                  | 2                     | 66                 | 6 534 000                           | 0,78              |  |
| LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)*      | CHF | 97 956             | 4 957              | 2 002                 | 100 911            | 7 180 827                           | 0,86              |  |
| LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*                    | CHF | 44 556             | 2 960              | 2 102                 | 45 414             | 14 387 155                          | 1,72              |  |
| LUZERNER KANTONALBANK AG RG*                  | CHF |                    | 13 700             | 2 000                 | 11 700             | 835 380                             | 0,10              |  |
| MEDMIX AG CHF0.01*                            | CHF | 13 650             |                    | 13 650                |                    |                                     |                   |  |
| MEYER BURGER TECHN CHF0.05*                   | CHF | 1 402 517          | 657 294            | 79 903                | 1 979 908          | 481 910                             | 0,06              | 1 979 907                                  |
| MOBIMO HLDG AG CHF23.40 (REGD)*               | CHF | 4 360              |                    |                       | 4 360              | 1 094 360                           | 0,13              |  |
| NESTLE SA CHF0.10(REGD)*                      | CHF | 1 645 251          | 110 415            | 123 419               | 1 632 247          | 160 058 141                         | 19,08             |  |
| NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)*                   | CHF | 1 365 945          | 68 435             | 141 751               | 1 292 629          | 109 278 856                         | 13,03             |  |
| OC OERLIKON CORP CHF1.00(REGD)*               | CHF | 117 973            |                    |                       | 117 973            | 426 118                             | 0,05              |  |
| PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*            | CHF | 13 582             | 819                | 501                   | 13 900             | 13 299 520                          | 1,59              |  |
| POLYPEPTIDE GROUP CHF0.01*                    | CHF | 8 400              |                    | 8 400                 |                    |                                     |                   |  |
| PSP SWISS PROPERTY CHF0.10 (REGD)*            | CHF | 27 699             | 1 271              | 896                   | 28 074             | 3 135 866                           | 0,37              |  |
| RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'*     | CHF | 312 663            | 23 092             | 16 843                | 318 912            | 34 091 693                          | 4,06              |  |
| SANDOZ GROUP AG CHF0.05*                      | CHF |                    | 266 058            | 1                     | 266 057            | 6 292 248                           | 0,75              |  |
| SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)*    | CHF | 12 256             | 694                |                       | 12 950             | 2 285 675                           | 0,27              |  |
| SCHWEITER TECH SHS*                           | CHF |                    | 575                |                       | 575                | 292 100                             | 0,03              |  |
| SFS GROUP AG CHF0.1*                          | CHF | 11 019             |                    |                       | 11 019             | 996 118                             | 0,12              |  |
| SGS SA CHF0.04*                               | CHF |                    | 95 102             | 3 072                 | 92 030             | 6 808 379                           | 0,81              |  |
| SIEGFRIED HLDG AG CHF27 (REGD)*               | CHF | 2 476              | 54                 | 60                    | 2 470              | 1 777 165                           | 0,21              |  |
| SIG COMBIBLOC GROU CHF0.1*                    | CHF | 205 912            | 20 637             | 12 799                | 213 750            | 4 272 863                           | 0,51              |  |
| SIKA AG CHF0.01 (REG)*                        | CHF | 92 403             | 7 638              | 5 722                 | 94 319             | 20 457 791                          | 2,44              |  |
| SOFTWAREONE HLD AG CHF0.01*                   | CHF | 65 850             | 4 850              | 2 200                 | 68 500             | 1 220 670                           | 0,15              |  |
| SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*             | CHF | 28 618             | 4 552              | 1 990                 | 31 180             | 6 688 110                           | 0,80              |  |
| ST GALLER KTBK AG CHF80 (REGD)*               | CHF | 1 688              | 121                |                       | 1 809              | 892 742                             | 0,11              |  |
| STADLER RAIL AG*                              | CHF | 34 275             | 1 000              |                       | 35 275             | 1 083 648                           | 0,13              |  |
| STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)*   | CHF | 67 753             | 4 910              | 3 781                 | 68 882             | 7 366 930                           | 0,88              |  |
| SULZER AG CHF0.01*                            | CHF | 10 602             |                    |                       | 10 602             | 791 969                             | 0,09              |  |
| SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)*                   | CHF | 32 658             | 942                |                       | 33 600             | 1 475 040                           | 0,18              |  |
| SWISS LIFE HLDG CHF5.1(REGD)*                 | CHF | 18 386             | 1 294              | 1 717                 | 17 963             | 10 450 873                          | 1,25              |  |
| SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)*              | CHF | 46 093             | 2 271              | 1 372                 | 46 992             | 3 966 125                           | 0,47              |  |
| SWISSCOM AG CHF1(REGD)*                       | CHF | 15 221             | 1 271              | 1 032                 | 15 460             | 8 410 240                           | 1,00              |  |
| SWISSQUOTE GP HLDG CHF0.20 (REGD)*            | CHF | 6 173              | 527                |                       | 6 700              | 1 165 130                           | 0,14              |  |
| TECAN GROUP AG CHF0.10(REGD)*                 | CHF | 7 705              | 353                | 270                   | 7 788              | 2 027 995                           | 0,24              |  |
| TEMENOS AG CHF5 (REGD)*                       | CHF | 40 365             | 2 146              | 1 411                 | 41 100             | 2 677 254                           | 0,32              |  |
| U-BLOX HOLDING AG CHF15.40 (REGD)*            | CHF |                    | 4 250              |                       | 4 250              | 364 225                             | 0,04              |  |

| Titel                               |     | 31.10.2022         |                    | 31.10.2023            |                    | Verkehrswert <sup>3</sup><br>in CHF | in % <sup>3</sup> | Davon<br>ausgeliehen<br>Anzahl/<br>Nominal |
|-------------------------------------|-----|--------------------|--------------------|-----------------------|--------------------|-------------------------------------|-------------------|--|
|                                     |     | Anzahl/<br>Nominal | Käufe <sup>1</sup> | Verkäufe <sup>2</sup> | Anzahl/<br>Nominal |                                     |                   |  |
| UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*           | CHF | 1 948 200          | 182 155            | 258 061               | 1 872 294          | 39 730 079                          | 4,74              |  |
| VALIANT HOLDING AG CHF3.30(REGD)*   | CHF | 9 422              | 750                | 422                   | 9 750              | 965 250                             | 0,12              |  |
| VAT GROUP AG CHF0.10*               | CHF | 15 943             | 1 452              | 944                   | 16 451             | 5 275 836                           | 0,63              | 13 878                                     |
| VONTOBEL HLDGS AG CHF1(REGD)*       | CHF | 16 293             | 928                |                       | 17 221             | 912 713                             | 0,11              |  |
| VZ HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*       | CHF | 9 240              |                    |                       | 9 240              | 824 208                             | 0,10              |  |
| YPSOMED HOLDING AG CHF14.15 (REGD)* | CHF |                    | 3 000              |                       | 3 000              | 750 000                             | 0,09              |  |
| ZEHNDER GROUP CHF0.05 (REGD) 'A'*   | CHF | 5 000              | 500                | 5 500                 |                    |                                     |                   |  |
| ZUGER KANTONALBK CHF500 (REGD)*     | CHF | 85                 |                    |                       | 85                 | 668 100                             | 0,08              |  |
| ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*       | CHF | 90 158             | 5 787              | 6 463                 | 89 482             | 38 530 949                          | 4,59              |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>                |     |                    |                    |                       |                    | <b>686 974 246</b>                  | <b>81,90</b>      |  |
| <b>Total Namensaktien</b>           |     |                    |                    |                       |                    | <b>688 184 701</b>                  | <b>82,05</b>      |  |

## Anrechte

### Schweiz

|  |     |  |           |           |  |                    |              |  |
|--|-----|--|-----------|-----------|--|--------------------|--------------|--|
| CREDIT SUISSE GROUP AG RIGHTS 08.12.22*                    | CHF |  | 1 505 000 | 1 505 000 |  |                    |              |  |
| LUZERNER KANTONALBANK AG RIGHTS 23-25.05.23*               | CHF |  | 9 445     | 9 445     |  |                    |              |  |
| MEYER BURGER TECHNOLOGY AG RIGHTS 09.11.22*                | CHF |  | 1 402 517 | 1 402 517 |  |                    |              |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>                                       |     |  |           |           |  |                    | <b>0,00</b>  |  |
| <b>Total Anrechte</b>                                      |     |  |           |           |  |                    | <b>0,00</b>  |  |
| <b>Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden</b> |     |  |           |           |  | <b>832 206 691</b> | <b>99,22</b> |  |

## Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

### Inhaberaktien

#### Schweiz

|                            |     |     |  |     |  |  |             |  |
|----------------------------|-----|-----|--|-----|--|--|-------------|--|
| SCHWEITER TECH CHF1**      | CHF | 575 |  | 575 |  |  |             |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>       |     |     |  |     |  |  | <b>0,00</b> |  |
| <b>Total Inhaberaktien</b> |     |     |  |     |  |  | <b>0,00</b> |  |

### Namensaktien

#### Schweiz

|   |     |       |     |       |  |                    |               |  |
|---|-----|-------|-----|-------|--|--------------------|---------------|--|
| LUZERNER KTBK CHF18.5 (REGD)**  | CHF | 1 889 |     | 1 889 |  |                    |               |  |
| SGS LTD CHF1(REGD)**  | CHF | 3 624 | 161 | 3 785 |  |                    |               |  |
| <b>TOTAL Schweiz</b>  |     |       |     |       |  |                    | <b>0,00</b>   |  |
| <b>Total Namensaktien</b>   |     |       |     |       |  |                    | <b>0,00</b>   |  |
| <b>Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden</b> |     |       |     |       |  |                    | <b>0,00</b>   |  |
| <b>Total Wertschriften</b>  |     |       |     |       |  | <b>832 206 691</b> | <b>99,22</b>  |  |
| (davon ausgeliehen)   |     |       |     |       |  | 17 438 310         | 2,08          |  |
| Bankguthaben auf Sicht  |     |       |     |       |  | 3 544 957          | 0,42          |  |
| Derivative Finanzinstrumente  |     |       |     |       |  | -6 560             | 0,00          |  |
| Sonstige Vermögenswerte   |     |       |     |       |  | 3 029 268          | 0,36          |  |
| <b>Gesamtfondsvermögen</b>  |     |       |     |       |  | <b>838 774 356</b> | <b>100,00</b> |  |
| Kurzfristige Bankverbindlichkeiten  |     |       |     |       |  | -2 731 320         |               |  |
| Andere Verbindlichkeiten  |     |       |     |       |  | -176 692           |               |  |
| <b>Nettofondsvermögen</b>   |     |       |     |       |  | <b>835 866 344</b> |               |  |

| Bewertungskategorie  | Verkehrswert per<br>31.10.2023 | in %<br>des Gesamt-<br>fondsvermögens <sup>3</sup> |
|--|--------------------------------|--|
| Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden   | 832 200 131                    | 99,22  |
| Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern  | –                              | –  |
| Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten | –                              | –  |
| <b>TOTAL</b>   | <b>832 200 131</b>             | <b>99,22</b>                                       |

<sup>1</sup> «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

<sup>2</sup> «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

<sup>3</sup> Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

\* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

\*\* bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

## Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

### Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

| Instrument                                       | Anzahl<br>Kontrakte | Währung | Deckung<br>in CHF | Variation Margin<br>in CHF | In % des<br>Vermögens |
|--|---------------------|---------|-------------------|----------------------------|-----------------------|
| <b>Futures auf Indices/Commodities/Währungen</b> |                     |         |                   |                            |                       |
| SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.23*              | 1                   | CHF     | 103 910           | -6 560                     | 0.00                  |
|  |                     |         | 103 910           | -6 560                     | 0.00                  |

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 103 910

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

\* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

### Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

| Instrument                                       | Währung | Käufe/<br>Kontrakte | Verkäufe/<br>Kontrakte |
|--|---------|---------------------|------------------------|
| <b>Futures auf Indices/Commodities/Währungen</b> |         |                     |                        |
| SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.12.22               | CHF     | 0                   | 1                      |
| SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.03.23               | CHF     | 1                   | 1                      |
| SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.23               | CHF     | 1                   | 1                      |
| SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.23               | CHF     | 1                   | 1                      |
| SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.23               | CHF     | 1                   | 0                      |

## Ergänzende Angaben

### Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:  
Art. 34 KKV-FINMA

| Position                                     | Betrag<br>in CHF | in % des Nettofonds-<br>vermögens |
|--|------------------|-----------------------------------|
| Total engagement-<br>erhöhende Positionen    | 103 910,00       | 0,01%                             |
| Total engagement-<br>reduzierende Positionen | –                | –                                 |

### Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

### Vergütung an die Fondsleitung

Pauschale Verwaltungskommission

– Effektiv erhobene pauschale Verwaltungskommission:

|              |             |
|--------------|-------------|
| Klasse F:    | 0,16% p.a.; |
| Klasse I-A1: | 0,19% p.a.; |
| Klasse P:    | 0,26% p.a.; |
| Klasse Q:    | 0,21% p.a.; |

– Maximale pauschale Verwaltungskommission gemäss Fonds-  
vertrag:

|              |             |
|--------------|-------------|
| Klasse F:    | 0,20% p.a.; |
| Klasse I-A1: | 0,30% p.a.; |
| Klasse P:    | 0,60% p.a.; |
| Klasse Q:    | 0,38% p.a.; |

berechnet auf dem durchschnittlichen Nettofonds-  
vermögen.

### Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannter «soft commissions» geschlossen.

### Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der AMAS in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

|              |       |
|--------------|-------|
| Klasse F:    | 0,17% |
| Klasse I-A1: | 0,20% |
| Klasse P:    | 0,27% |
| Klasse Q:    | 0,22% |

### Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen des Anlagefonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des Anlagefonds erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Anlagefonds bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 17 Ziff. 7 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Anlagefonds. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung kann, anstelle der oben erwähnten durchschnittlichen Nebenkosten bei der Anpassung auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

In den in § 17 Ziff. 4 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Fällen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, zudem der Höchstwert von 2% des Nettoinventarwerts überschritten werden. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Überschreitung unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den bestehenden und neuen Anlegern mit.

### Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

### Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 0.96

USD 1 = CHF 0.91

# Anhang zu Ergänzende Angaben

## Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

### Grundsätze der Bewertung

1. Der Nettoinventarwert (Bewertungs-Nettoinventarwert) des Anlagefonds 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 Schweizer Franken (CHF) berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des Anlagefonds geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens statt. Die Fondsleitung kann jedoch auch an Tagen, an welchen keine Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, den Nettoinventarwert eines Anteils («nicht handelbarer Nettoinventarwert») berechnen (siehe Ziff. 1.7 des Prospekts). Solche nicht handelbare Nettoinventarwerte können veröffentlicht werden, dürfen aber nur für Performance-Berechnungen und -Statistiken oder für Kommissionsberechnungen, auf keinen Fall aber als Basis für Zeichnungs- und Rücknahmeaufträge verwendet werden.
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. 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 basiert auf der jeweils relevanten Zinskurve. Die auf der Zinskurve basierende Bewertung bezieht sich auf die Komponenten Zinssatz und Spread. Dabei werden folgende Grundsätze angewandt: Für jedes Geldmarktinstrument werden die der Restlaufzeit nächsten Zinssätze interpoliert. Der dadurch ermittelte Zinssatz wird unter Zuzug eines Spreads, welcher die Bonität des zugrundeliegenden Schuldners wiedergibt, in einen Marktkurs konvertiert. Dieser Spread wird bei signifikanter Änderung der Bonität des Schuldners angepasst.
4. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
5. Derivative Finanzinstrumente, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Derivative Finanzinstrumente, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden (OTC-Derivate), 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.

6. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Fonds 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 Kommissionsätze 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 Nettofondsvermögen, getätigt wurden.

### Grundsätze der Nettoinventarwertberechnung

Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf CHF 0.01 gerundet.

## Effektenleihe

Die Gesellschaft darf ebenfalls Teile ihres Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

## Effektenleihe und Sicherheiten

**Berichtszeitraum:** UBS 100 Index-Fund  
**1. November 2022 -** Switzerland  
**31. Oktober 2023** (CHF)

**Kontrahentenrisiko aus  
der Effektenleihe  
per 31. Oktober 2023**

|   |                   |
|---|-------------------|
| UBS AG                                  |                   |
| – Marktwert der verliehenen<br>Effekten | 17 236 771.00 CHF |
| – Sicherheiten                          | 18 105 610.81 CHF |

**Aufschlüsselung der Sicherheiten  
(Gewichtung in %)  
per 31. Oktober 2023**

**nach Art der Vermögenswerte:**

|            |        |
|------------|--------|
| – Anleihen | 33.31% |
| – Aktien   | 66.69% |

**Effektenleihe**

|  |                |
|--|----------------|
| <b>Erträge aus der<br/>Effektenleihe</b> | 104 410.43 CHF |
|--|----------------|

|   |               |
|---|---------------|
| <b>Operative Kosten der<br/>Effektenleihe</b> | 41 763.00 CHF |
|---|---------------|

|   |               |
|---|---------------|
| <b>Fondserträge aus der<br/>Effektenleihe</b> | 62 647.43 CHF |
|---|---------------|

Die Erfassung der Ausgleichszahlungen und der Kommissionserträge aus Effektenleihe in den Erfolgsrechnungen sowie der Ausweis der im Inventar der Fondsvermögen der Anlagefonds ausgeliehenen Wertschriften und der erhaltenen Sicherheiten für ausgeliehene Wertschriften erfolgen nach dem Prinzip der valutagerechten Verbuchung.

Basel, 27. Februar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Jahresrechnung des

### UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF), Basel

#### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF), bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Oktober 2023, der Erfolgsrechnung 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 entspricht die Jahresrechnung (Seiten 2 bis 15) 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 Jahresrechnung» 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.



#### Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die in einem Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.



#### Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung

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



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

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, 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 Jahresrechnung 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 Jahresrechnung 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

Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Zugelassener Revisionsexperte

# Sonstige Informationen

## UBS 100 Index-Fund Switzerland (CHF)

Der Schweizer Aktienmarkt verzeichnete im Rechnungsjahr vom 1. November 2022 bis zum 31. Oktober 2023 eine negative Performance. Eine der grössten Sorgen der Anlegerinnen und Anleger im Berichtszeitraum betraf die Verfassung des Bankensystems zu beiden Seiten des Atlantik. In der Schweiz kündigte UBS die Übernahme von Credit Suisse an. Laut der Schweizer Bankenaufsicht Finma dürfte dieser Schritt «die Stabilität für die Kunden der Bank und das Finanzzentrum Schweiz sicherstellen». Die Gewinne an den Aktienmärkten im 2. Quartal zeugten jedoch von der allgemeinen Zuversicht, dass die Aufsichtsbehörden schnell und nachdrücklich genug gehandelt hatten, um eine ausgewachsene Bankenkrise zu vermeiden. Eine Reihe anderer Risiken bereitete den Anlegern ebenfalls Sorge. Dazu zählten das Risiko einer weiteren Zinserhöhung der US-Notenbank (Fed) aufgrund der hartnäckig hohen Inflationsdaten und erneute Anzeichen, dass das Wachstum in China nicht so schnell wie erwartet wieder in Schwung kommt. Die Frage, ob es zu einer sanften oder harten Landung der US-Wirtschaft kommen wird, stand im Mittelpunkt. Denn die Gefahr einer Rezession in den USA stellt auch ein Risiko für die Schweizer Wirtschaft dar. In der Vergangenheit führten heftige Zinserhöhungen oft zu Rezessionen. Doch bisher hat sich die US-Wirtschaft robust gehalten. Die Kursgewinne vom Juli spiegelten den Optimismus, dass sich die Fed dem Ende ihres Zinserhöhungszyklus nähert. Doch der unablässige Anstieg der Anleihenrenditen übte im September und Oktober Abwärtsdruck auf die Aktienmärkte aus.

Das Anlageziel besteht in der Erwirtschaftung einer Performance, die sich am Benchmark orientiert, dem UBS 100 Index. Die Abweichungen der Performance des Subfonds gegenüber dem Benchmark ergeben sich üblicherweise aus Gebühren (Total Expense Ratio), Transaktionskosten sowie Mittelzu- und -abflüssen. Der UBS 100 Index wird von der SIX (Swiss Exchange) vierteljährlich im März, Juni, September und Dezember angepasst.

 Follow us on LinkedIn

[www.ubs.com](http://www.ubs.com)

