

# SWISSCANTO (CH) IPF III VORSORGE FONDS 75 PASSIV

## Jahresbericht per 30.09.2023

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

<b>Klasse</b>	<b>Valor</b>	<b>Währung</b>
NT CHF	51215777	CHF
VT CHF	51196141	CHF

Rechnungswährung: CHF

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

An den Verwaltungsrat der  
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

## Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnungen



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnungen des Anlagefonds

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

mit den Teilvermögen

- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Index Equity Fund MSCI® World ex Switzerland
- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 45 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 75 Passiv
- ▶ Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 95 Passiv

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

Nach unserer Beurteilung entsprechen die beigegeführten Jahresrechnungen dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag.



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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller  
Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Yves Lauber  
Zugelassener Revisionsexperte

**Beilage**

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

## Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	13
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	14
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	14
7	Pauschale Verwaltungskommission	14
8	Benchmark	15
9	TER	15
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	15
11	Fussnoten	15
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	16
13	Pflichtpublikationen	18

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

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

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

## Geschäftsleitung

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

## Delegationen

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

## Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

## 2 Vertriebsorganisation

### Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

### Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## 3 Abschlusszahlen

### Übersicht

	von	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	12.03.2020
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
<b>Konsolidiert</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		570'679'832.46	427'977'726.23	393'114'387.15	193'452'584.95
<b>Klasse NT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		311'474'326.95	199'249'958.01	163'744'614.11	47'895'971.48
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'276'068.297	1'581'502.929	1'103'109.298	392'650.426
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		136.8475	125.9877	148.4392	121.9812
Thesaurierung je Anteil		2.83	2.65	2.08	2.04
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.04 %	0.04 %	0.04 %	0.04 %
<b>Klasse VT CHF</b>	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		259'205'505.51	228'727'768.22	229'369'773.04	145'556'613.47
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'954'180.172	1'865'959.381	1'582'154.536	1'217'165.039
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		132.6416	122.5792	144.9731	119.5866
Thesaurierung je Anteil		2.24	2.04	1.51	1.77
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.42 %	0.42 %	0.42 %	0.42 %

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

### Performance

	2022 / 2023	2022	2021	2020
Klasse NT CHF (Lancierung 12.03.2020)	8.62 %	-15.19 %	16.60 %	32.70 %
Klasse VT CHF (Lancierung 12.03.2020)	8.21 %	-15.51 %	16.16 %	32.30 %

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kosten und Kommissionen unberücksichtigt.

### Vermögensrechnung

(Verkehrswerte)	30.09.2023	30.09.2022
Bankguthaben auf Sicht	24'311.77	769'708.15
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	571'098'574.11	425'068'947.53
Derivative Finanzinstrumente	-601'096.98	-622'691.02
Sonstige Vermögenswerte	3'691'180.57	2'834'571.12
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>574'212'969.47</b>	<b>428'050'535.78</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-3'452'288.18	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-80'848.83	-72'809.55
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>570'679'832.46</b>	<b>427'977'726.23</b>

## Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Klasse NT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'581'502.929	1'103'109.298
Ausgegebene Anteile		830'900.478	642'484.715
Zurückgenommene Anteile		-136'335.110	-164'091.084
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'276'068.297</b>	<b>1'581'502.929</b>
<b>Klasse VT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'865'959.381	1'582'154.536
Ausgegebene Anteile		359'071.937	497'331.793
Zurückgenommene Anteile		-270'851.146	-213'526.948
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>1'954'180.172</b>	<b>1'865'959.381</b>

## Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Konsolidiert</b>			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		427'977'726.23	393'114'387.15
Saldo aus dem Anteilverkehr		105'653'937.57	109'960'135.92
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		37'048'168.66	-75'096'796.84
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>570'679'832.46</b>	<b>427'977'726.23</b>

## Erfolgsrechnung

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
<b>Konsolidiert</b>			
<b>Ertrag</b>			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		2.35	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-0.44	-879.60
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		11'231'942.18	8'570'203.22
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		966'116.30	534'373.24
<b>Total Ertrag</b>		<b>12'198'060.39</b>	<b>9'103'696.86</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-4'610.10	-4'700.55
Reglementarische Vergütungen		-982'859.52	-916'216.74
Sonstige Aufwendungen		-1'515.30	-3'337.75
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-367'469.78	-171'061.85
<b>Total Aufwand</b>		<b>-1'356'454.70</b>	<b>-1'095'316.89</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>10'841'605.69</b>	<b>8'008'379.97</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		2'179'350.34	-1'763'062.57
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		178'987.22	155'298.25
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>13'199'943.25</b>	<b>6'400'615.65</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		23'848'225.41	-81'497'412.49
<b>Gesamterfolg</b>		<b>37'048'168.66</b>	<b>-75'096'796.84</b>

## Verwendung des Erfolges

	30.09.2023	30.09.2022
<b>Klasse NT CHF</b>		
Nettoertrag	6'449'226.23	4'191'245.44
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>6'449'226.23</b>	<b>4'191'245.44</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	6'449'226.23	4'191'245.44
<b>Total</b>	<b>6'449'226.23</b>	<b>4'191'245.44</b>
<b>Klasse VT CHF</b>		
Nettoertrag	4'392'379.46	3'817'134.53
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>4'392'379.46</b>	<b>3'817'134.53</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	4'392'379.46	3'817'134.53
<b>Total</b>	<b>4'392'379.46</b>	<b>3'817'134.53</b>

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

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
<b>Wertpapiere, die an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden</b>							<b>571'098'574.11</b>	<b>99.46</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>571'098'574.11</b>	<b>99.46</b>	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	109'145	12'827	56'798	65'174 CHF	141.36	9'213'092.20	1.60	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	26'039	6'487	950	31'577 CHF	119.79	3'782'495.76	0.66	a)
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	26'957	6'225	423	32'758 CAD	178.40	3'954'293.85	0.69	a)
CH0117045077	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB DOM CHF NT	149'770	42'166	2'409	189'527 CHF	106.11	20'109'926.71	3.50	a)
CH0117045127	SWC (CH) INDEX BF TOTAL MARKET AAA-BBB FOR CHF NT	89'161	24'024	1'747	111'438 CHF	102.91	11'467'790.20	2.00	a)
CH0117045317	SWC (CH) IBF WORLD EX CHF GOVT. (I) NTH1 CHF	65'685	26'248	0	91'932 CHF	93.11	8'560'107.52	1.49	a)
CH0117048352	SWC (CH) INDEX BF WLD EX JPY/CHF INFL.-L. NTH1 CHF	75'927	32'465	0	108'393 CHF	104.57	11'334'707.76	1.97	a)
CH0117052396	SWC (CH) INDEX BF CORP. EUR RESPONSIBLE NT EUR	22'769	9'137	154	31'751 EUR	113.79	3'499'313.64	0.61	a)
CH0117052420	SWC (CH) INDEX BF CORP. USD RESPONSIBLE NT USD	48'981	18'345	210	67'115 USD	120.80	7'416'879.69	1.29	a)
CH0117052453	SWC (CH) INDEX BF CORP. WORLD EX EUR/USD NT CHF	3'351	2'822	41	6'132 CHF	97.00	594'848.79	0.10	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	149'938	46'161	14'132	181'966 CHF	156.48	28'473'334.68	4.96	a)
CH0132501872	SWC (CH) INDEX COMMODITY FUND NTH1 CHF	352'009	178'289	13'172	517'125 CHF	49.40	25'544'292.69	4.45	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	178'476	41'850	4'067	216'259 CHF	291.54	63'048'270.06	10.98	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	486'726	119'734	10'151	596'309 CHF	152.93	91'194'071.91	15.88	a)
CH0398970274	SWC (CH) IX BF EMMA HARD CURRENCY NTH1 CHF	27'645	9'335	0	36'980 CHF	76.48	2'828'310.46	0.49	a)
CH0414225430	SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD	454	52	230	277 USD	169'781.65	42'992'315.66	7.49	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	108'387	23'662	1'210	130'839 CHF	127.43	16'672'923.29	2.90	a)
CH0512828978	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN ST	72	8	37	44 JPY	14'484'538.68	3'871'290.81	0.67	a)
CH0527915919	SWC(CH)IPF I INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH ST CHF	295	100	13	382 CHF	150'427.96	57'439'863.91	10.00	a)
CH0527916826	SWC (CH) IPF III INDEX EF MSCI® WORLD EX CH ST CHF	266	65	8	323 CHF	158'933.51	51'394'804.64	8.95	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	390'782	138'492	6'467	522'808 CHF	87.87	45'938'006.88	8.00	a)
CH1117196035	SWC (CH) INDEX BF CORP. CHF RESPONSIBLE NT CHF	48'551	13'052	268	61'336 CHF	93.18	5'715'336.44	1.00	a)
CH1223982641	SWC (CH) IPF I IEF USA RESPONSIBLE ST USD	0	420	6	414 USD	113'492.92	42'964'789.08	7.48	a)
CH1223983292	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	0	53	1	52 JPY	12'198'074.39	3'871'424.39	0.67	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	0	85	2	82 CHF	112'187.40	9'216'083.09	1.60	a)
<b>CH</b>							<b>571'098'574.11</b>	<b>99.46</b>	

### Derivative Finanzinstrumente

**-601'096.98 -0.10**

### Devisentermingeschäfte

USD/CHF	Verfall 02.11.2022	70'195'978	72'017'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2022	9'731'283	10'148'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	4'042'674	3'714'000	CHF/GBP	0.00	0.00
JPY/CHF	Verfall 02.11.2022	5'489'075	810'460'000	CHF/JPY	0.00	0.00
AUD/CHF	Verfall 02.11.2022	1'928'264	3'044'000	CHF/AUD	0.00	0.00
CAD/CHF	Verfall 02.11.2022	3'186'782	4'475'000	CHF/CAD	0.00	0.00
SEK/CHF	Verfall 02.11.2022	813'294	9'270'000	CHF/SEK	0.00	0.00
DKK/CHF	Verfall 02.11.2022	638'784	4'954'000	CHF/DKK	0.00	0.00
NOK/CHF	Verfall 02.11.2022	190'395	2'080'000	CHF/NOK	0.00	0.00
HKD/CHF	Verfall 02.11.2022	697'273	5'605'000	CHF/HKD	0.00	0.00
SGD/CHF	Verfall 02.11.2022	329'931	484'000	CHF/SGD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2022	99'841	102'000	CHF/USD	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2022	19'419	20'000	CHF/EUR	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	9'958	9'000	CHF/GBP	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2022	96'378	98'000	CHF/USD	0.00	0.00
USD/CHF	Verfall 02.11.2022	86'728	87'000	CHF/USD	0.00	0.00
GBP/CHF	Verfall 02.11.2022	7'730	7'000	CHF/GBP	0.00	0.00
EUR/CHF	Verfall 02.11.2022	15'492	16'000	CHF/EUR	0.00	0.00

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		67'175	67'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		8'778	9'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		11'739	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		7'944	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		89'175	89'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		2'057'659	3'221'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		3'427'864	4'691'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		705'398	5'299'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		73'694'091	73'953'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		902'312	9'932'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		335'776	476'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		10'693'957	10'791'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		4'366'179	3'785'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		647'477	5'097'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		5'702'199	844'560'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.12.2022		211'640	2'203'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		6'742	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		62'164	63'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		52'762	53'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		68'106	69'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		18'783	19'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		25'754	26'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		58'952	60'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		9'862	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		19'642	20'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		109'090	113'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		11'810	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		126'507	134'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		219'962	233'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		19'583	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		17'927	19'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		196'715	209'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		17'646	18'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		40'418	41'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		19'102	17'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		146'862	154'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		18'338	2'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		42'739	45'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		13'596	12'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		28'557	29'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		14'953	2'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		7'990	88'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		14'049	22'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		144'771	153'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		87'652	89'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		29'719	42'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		6'092	46'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		33'987	5'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		34'333	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		10'237	9'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		7'489	1'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		8'440	12'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		22'596	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		50'072	53'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		9'512	10'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		75'621'403	79'803'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		11'844'802	12'038'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		4'650'282	4'093'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		2'272'275	3'569'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		3'548'987	5'081'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		953'047	10'592'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2023		217'877	2'297'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		774'269	5'856'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		714'349	5'886'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		373'840	541'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		100'097	107'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		101'722	109'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		8'213	13'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		38'130	41'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		8'817	14'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		10'303	9'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		22'634	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		13'656	20'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		245'503	263'000		CHF/USD	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		124'666	135'000	CHF/USD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.01.2023		6'797	75'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		12'279	18'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		29'793	26'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		63'984	65'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		9'059	8'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		8'845	13'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		181'537	196'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		18'772	19'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		8'834	13'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		22'746	23'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		10'180	9'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		167'456	180'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2023		11'236	18'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		305'521	328'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		21'480	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		45'390	46'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		13'611	20'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		365'953	396'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		16'296	24'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		21'324	19'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2023		11'709	19'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		46'271	47'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		15'724	16'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		6'722	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		112'829	122'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		92'926	100'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		9'859	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		18'530	27'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		213'465	229'000	CHF/USD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2023		12'496	20'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 04.01.2023		9'854	111'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 04.01.2023		24'442	39'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		44'657	40'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 04.01.2023		8'808	74'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 04.01.2023		8'612	65'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 04.01.2023		35'493	52'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		94'604	96'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		688'198	742'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 04.01.2023		20'033	18'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		121'878	132'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 04.01.2023		41'367	42'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		6'308'358	918'560'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		9'603	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		28'617	4'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		9'593	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		18'224	2'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		13'644	2'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		30'661	4'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		33'823	4'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		9'827	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		10'553	1'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		33'019	4'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.01.2023		64'317	9'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2023		3'496'726	5'143'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.02.2023		2'328'337	3'720'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 02.02.2023		392'955	573'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2023		957'909	10'847'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.02.2023		222'072	2'378'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 02.02.2023		850'843	7'199'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2023		6'482'875	925'460'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		73'811'192	80'173'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2023		4'745'769	4'271'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023		11'929'281	12'127'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2023		844'288	6'382'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.02.2023		12'613	142'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		310'575	332'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.02.2023		162'258	164'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.02.2023		11'044	83'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2023		59'574	53'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.02.2023		7'044	1'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		578'323	624'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.02.2023		39'092	35'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.02.2023		9'593	14'000	CHF/CAD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		6'448	73'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		8'266	13'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		128'973	131'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		20'701	21'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		186'921	204'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		15'323	2'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		8'942	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		33'153	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		13'181	98'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		68'744	61'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		35'925	56'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		150'148	150'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		13'213	111'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		55'338	80'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		47'719	6'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		15'433	174'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'052'517	1'133'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		21'327	23'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		41'131	41'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		19'875	20'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		40'443	44'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		6'919	7'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		17'323	19'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		7'926	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		129'149	141'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		44'500	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		58'540	8'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		20'936	21'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		9'924	1'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		142'591	155'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		6'829	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		44'277	48'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		23'010	23'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		26'761	29'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		82'596'556	89'367'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		13'778'073	13'758'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		5'234'987	4'594'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		7'034'305	987'960'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		3'896'146	5'660'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		2'619'776	4'032'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.03.2023		225'496	2'437'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		897'745	6'667'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		1'081'333	12'171'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		428'526	610'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.03.2023		919'406	7'789'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		38'522	39'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		31'305	34'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		98'979	107'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		45'439	46'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		15'820	16'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		33'363	36'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		62'402	63'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		272'470	290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		44'751	6'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		15'928	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		12'611	20'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		1'114'201	12'359'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		82'207'533	87'924'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		5'265'418	4'677'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		13'836'347	13'933'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		6'859'034	999'160'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		851'979	7'137'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		946'208	7'092'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		3'837'775	5'581'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		2'485'539	3'959'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		411'644	594'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		227'499	2'514'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		22'448	20'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		23'434	3'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		7'583	12'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		39'410	42'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		11'153	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		55'675	50'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		8'939	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		164'956	181'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		25'178	3'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		46'100	50'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		9'746	1'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		21'342	23'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		8'695	14'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		11'493	17'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		43'673	44'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		241'442	261'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		26'057	3'700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		19'278	17'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		8'222	9'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		62'353	68'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		7'331	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		7'898	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		47'396	6'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		206'046	225'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		14'707	22'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		31'607	32'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		13'488	12'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		9'734	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		6'783	11'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		28'921	29'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		254'911	277'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		12'480	11'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		10'804	16'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		24'614	3'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		11'671	19'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		23'758	21'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		53'759	54'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		36'780	5'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		17'587	26'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		371'245	404'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		1'071'585	12'155'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		993'269	7'441'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		420'823	613'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2023		859'750	7'395'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		3'752'198	5'575'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		2'398'120	3'929'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		82'879'732	90'949'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		215'304	2'454'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		14'085'509	14'166'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		5'273'895	4'671'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		27'089	24'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		326'661	359'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		15'562	23'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		9'884	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		46'636	47'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		340'135	376'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		31'801	32'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		26'056	23'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		48'791	55'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		47'293	53'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		9'610	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		16'642	15'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		231'459	258'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		38'223	39'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		170'321	190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		18'686	19'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		7'801	7'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		148'042	165'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		8'938	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		70'842	72'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		16'683	15'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		37'264	38'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		10'781	11'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		55'352	62'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		75'643	85'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		468'069	522'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		10'062	9'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		24'684	25'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		27'669	42'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		7'114'783	1'034'160'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		31'072	4'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		7'346	1'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 08.05.2023		54'169	8'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		84'434'974	94'714'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		14'666'096	14'925'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.06.2023		5'570'530	5'003'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		7'183'209	1'088'860'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		3'865'304	5'913'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.06.2023		869'603	7'646'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.06.2023		1'135'479	13'098'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.06.2023		1'041'278	7'899'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.06.2023		2'484'286	4'221'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.06.2023		220'233	2'632'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		8'767	9'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		25'643	29'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		65'682	74'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		51'505	7'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.06.2023		42'271	6'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.06.2023		7'968	12'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		76'461	86'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		23'428	26'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		28'774	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		25'210	26'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 02.06.2023		20'000'000	130'215	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 02.06.2023		59'000	65'966	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 02.06.2023		155'000	150'867	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 02.06.2023		650'000	587'631	USD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 02.06.2023		86'000	9'935	HKD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 02.06.2023		66'000	43'917	CAD/CHF		0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 02.06.2023		174'000	14'678	SEK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 02.06.2023		109'000	14'245	DKK/CHF		0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 02.06.2023		48'000	28'376	AUD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.06.2023		50'785	56'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.06.2023		24'274	25'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.06.2023		427'046	640'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		88'338'759	97'377'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		14'342'141	14'774'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.07.2023		5'439'783	4'844'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.07.2023		7'534'002	1'153'860'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.07.2023		3'815'391	5'732'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.07.2023		2'407'231	4'090'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.07.2023		1'085'259	13'049'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		206'625	2'558'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		1'046'714	8'032'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		810'800	6'994'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		416'221	621'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		27'100	30'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		11'630	12'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		24'493	27'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 05.07.2023		15'000	17'155	GBP/CHF		0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 05.07.2023		40'000	39'179	EUR/CHF		0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 05.07.2023		6'400'000	40'729	JPY/CHF		0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 05.07.2023		32'000	28'729	USD/CHF		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.07.2023		8'960	10'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.07.2023		6'877	7'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		90'797'066	101'329'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		7'669'249	1'233'260'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		14'357'277	14'722'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		5'359'811	4'729'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		2'413'290	4'061'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		3'849'898	5'692'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		208'778	2'501'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		1'066'935	12'898'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		1'000'106	7'633'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		403'682	610'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		802'472	7'014'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		9'830	11'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		13'665	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		138'763	155'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		41'917	43'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		19'681	22'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		9'733	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		27'526	31'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		13'627	14'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		43'812	51'000	CHF/USD		0.00	0.00	

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		38'097	34'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		14'030	128'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		158'889	165'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		24'702	38'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		223'519	261'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		43'866	75'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		7'134	11'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		16'437	19'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		12'505	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		90'851	105'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		8'873	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		43'157	45'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		50'029	58'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		24'819	26'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		81'651	94'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		11'459	12'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		7'998	1'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		7'659	8'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		58'991	68'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		6'802	1'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		14'943'450	15'616'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		5'540'532	4'971'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		7'649'592	1'247'760'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		224'208	2'626'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		3'921'164	5'988'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		811'810	7'304'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		92'743'220	106'962'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		1'091'863	13'240'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		2'521'348	4'341'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		432'005	662'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		1'008'196	7'849'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		12'172	14'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		12'864	2'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		76'859	88'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		12'444	13'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		8'886	8'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		21'107	22'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		119'678	137'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		54'234	9'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		331'270	376'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		93'365'096	106'398'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		14'726'168	15'385'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		5'422'207	4'861'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		7'533'186	1'246'560'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		2'409'034	4'231'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		3'868'325	5'966'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		1'017'483	12'604'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		219'532	2'660'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		1'106'527	8'616'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		422'760	650'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CHF/CAD Verfall 03.10.2023		10'000	6'648		CAD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/DKK Verfall 03.10.2023		85'000	10'923		DKK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/GBP Verfall 03.10.2023		43'000	47'736		GBP/CHF	0.00	0.00	
	CHF/AUD Verfall 03.10.2023		60'000	34'612		AUD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/SEK Verfall 03.10.2023		122'000	9'775		SEK/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		570'000	511'124		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/EUR Verfall 03.10.2023		113'000	108'233		EUR/CHF	0.00	0.00	
	CHF/USD Verfall 03.10.2023		43'000	38'556		USD/CHF	0.00	0.00	
	CHF/JPY Verfall 03.10.2023		1'600'000	9'733		JPY/CHF	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		46'010	7'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		33'401	30'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		73'390	76'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		7'251	56'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		6'936	84'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		579'548	635'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		33'840	50'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		17'542	30'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		10'634	11'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		96'792	106'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		96'222	105'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		750'755	6'700'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	CHF/HKD Verfall 04.10.2023		93'000	10'663		HKD/CHF	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		91'257'447	100'655'000		CHF/USD	-503'503.26	-0.09	b)
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		13'971'761	14'509'000		CHF/EUR	-51'252.42	-0.01	b)

ISIN / Fälligkeitsdatum	Bezeichnung	Anz / Nom in Tsd. 01.10.2022	Kauf Zugang 2)	Verkauf Abgang 3)	Anz / Nom in Tsd. Wäh- rung 30.09.2023	Kurs 8)	Kurswert CHF	in % 7)	Kat.
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		5'532'023	4'981'000		CHF/GBP	-11'184.77	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		7'825'261	1'277'360'000		CHF/JPY	-19'838.57	0.00	b)
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		2'417'597	4'110'000		CHF/AUD	-3'385.30	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		3'875'215	5'745'000		CHF/CAD	-352.27	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		237'379	2'780'000		CHF/NOK	-1'011.49	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		717'209	6'187'000		CHF/HKD	-3'208.74	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		427'567	641'000		CHF/SGD	-1'171.39	0.00	b)
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		1'017'955	12'147'000		CHF/SEK	-2'706.31	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		1'074'218	8'312'000		CHF/DKK	-3'482.46	0.00	b)

#### Devisentermingeschäfte

**-601'096.98 -0.10**

#### Vermögensaufstellung

	Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht	24'311.77	0.00
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	571'098'574.11	99.46
Derivative Finanzinstrumente	-601'096.98	-0.10
Sonstige Vermögenswerte	3'691'180.57	0.64
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>574'212'969.47</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-3'452'288.18	
Andere Verbindlichkeiten	-80'848.83	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>570'679'832.46</b>	

#### Bewertungskategorien

	Kurswert CHF	in % 7)
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG);	571'098'574.11	99.46
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-601'096.98	-0.10
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	0.00	0.00

#### OTC Gegenparteien

Zürcher Kantonalbank

#### Devisenkurse

AUD	1 = CHF	0.59041192
CAD	1 = CHF	0.67662722
DKK	100 = CHF	12.98841400
EUR	1 = CHF	0.96854454
GBP	1 = CHF	1.11655914
HKD	100 = CHF	11.68051000
JPY	100 = CHF	0.61303400
NOK	100 = CHF	8.59705800
SEK	100 = CHF	8.42031600
SGD	1 = CHF	0.67023225
USD	1 = CHF	0.91480000

## 4 Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I

Engagement	Währung	Betrag	in % 28)
Total der engagementerhöhenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	-	-
Total der engagementreduzierenden Positionen (Basiswertäquivalent)	CHF	129'331'558.26	22.663

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

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	Währung	Ausgabespesen, Ausgabekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Ausgabespesen in %	Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)		Durchschnitt Rücknahmespesen in %
		Teilvermögen	Fondsleitung		Teilvermögen	Fondsleitung	
NT CHF	CHF	0.00 - 0.15	-	0.094	0.00 - 0.07	-	0.004
VT CHF	CHF	0.00 - 0.15	-	0.094	0.00 - 0.07	-	0.004

Die Anleger können Angaben über die Höhe der effektiv belasteten Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen bei der Fondsleitung beziehen. Die Berechnung der Ausgabe- bzw. Rücknahmespesen ist im Fondsvertrag § 19 Ziff. 3 geregelt.

## 6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

Am Bilanzstichtag ausgeliehene Effekten	Währung	Betrag
Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Obligationen, Wandelobligationen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	CHF	-
Andere Wertpapiere	CHF	-

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich sogenannten «soft commissions» geschlossen.

## 7 Pauschale Verwaltungskommission

Die pauschale Verwaltungskommission (PVK) wird verwendet für die Leitung, die Entschädigung der Depotbank (PAF) für die von ihr erbrachten Dienstleistungen, wie auch für das Asset Management und den Vertrieb (PMF) des Teilvermögens.

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in % Eff	PAF p.a. in % Eff	VK Zielfonds p.a. in %	
	Eff	Max			Max	
NT CHF	-	-	-	-	4.000	
VT CHF	0.380	1.200	0.330	0.050	4.000	

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022): Aus der pauschalen Verwaltungskommission können Gebühren bzw. Entschädigungen (inkl. Retrozessionen) zur Deckung der Vertriebstätigkeit des Fonds bezahlt werden. Als Vertriebstätigkeit gilt insbesondere jede Tätigkeit in Zusammenhang mit dem Angebot, der Werbung und der Vermittlung des Fonds. Die Gesellschaft bzw. die Fondsleitung kann Anlegern aufgrund objektiver Kriterien Rabatte auf den dem Fonds belasteten Gebühren bzw. Kosten gewähren.

## 8 Benchmark

Dieses Teilvermögen hat keinen Referenzindex.

## 9 TER

Die TER wurde gemäss «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt.

## 10 Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 17.01.2024

Thesaurierung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 22.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
NT CHF 34)	Nein	CHF	2.833	-	2.833
VT CHF 34)	Nein	CHF	2.247	-	2.247

## 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.
- 34) Anwendung des Meldeverfahrens bei der ESTV, daher wird kein VST-Abzug bei der Thesaurierung vorgenommen.

## 12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens gemäss § 20 Ziff. 1 berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte in den Hauptanlageländern 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. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
5. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird mathematisch auf 0.0001 der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung oder der jeweiligen weiteren Zeichnungs- und Rücknahmewährung (gemäss Ziff. 8 der Tabelle im Anhang) der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
6. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren 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 Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

## Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des

### Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund III (IPF III)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts für qualifizierte Anleger der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" (nachfolgend der "Umbrella-Fonds")

mit den Teilvermögen

Swisscanto (CH) IPF III Index Equity Fund MSCI® World ex Switzerland

Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 45 Passiv

Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 75 Passiv

Swisscanto (CH) IPF III Vorsorge Fonds 95 Passiv

(nachfolgend die "Teilvermögen")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen, die Anteile und Anteilklassen im Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Der Anlegerkreis bei der bestehenden Anteilsklasse VT CHF soll im Fondsvertrag unter § 6 Ziff. 4 erweitert werden. Bis anhin ist diese Anteilsklasse den folgenden Institutionen der beruflichen Vorsorge (2. Säule) und der gebundenen individuellen Vorsorge 3a vorbehalten: Freizügigkeitsstiftungen gemäss dem Bundesgesetz über die Freizügigkeit in der beruflichen Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (Freizügigkeitsgesetz, FZG) und Vorsorgeeinrichtungen/-formen der Säule 3a gemäss Verordnung über die steuerliche Abzugsberechtigung für Beiträge an anerkannte Vorsorgeformen (BVV 3). Neu soll diese Anteilsklasse ebenfalls Einrichtungen mit dem Zweck der Durchführung der ausserobligatorischen beruflichen Vorsorge gemäss Art. 1e der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV 2) zur Verfügung stehen.

\*\*\*

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2<sup>bis</sup> i.V.m. Art. 35a Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anlegerinnen und Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die in der vorliegenden Publikation umschriebenen Änderungen des Fondsvertrages erstreckt.

Die Anlegerinnen und Anleger werden darauf hingewiesen, dass sie innert 30 Tagen ab dem Zeitpunkt dieser Veröffentlichung bei der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern, gegen die in dieser Veröffentlichung erwähnten Änderungen des Fondsvertrages Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrages in bar verlangen können.

Der Fondsvertrag mit Anhang, der Jahresbericht sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 12. Mai 2023

### Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

### Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank  
Zürich