

# SWISSCANTO (CH) IPF III VORSORGE FONDS 95 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	51215778	CHF
VT CHF	51196142	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	15
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	16
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	16
7	Pauschale Verwaltungskommission	16
8	Benchmark	17
9	TER	17
10	Thesaurierung des Nettoertrags 2022 / 2023	17
11	Fussnoten	17
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	18
13	Pflichtpublikationen	20

# 1 Organisation und Verwaltung

## Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG  
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

## Verwaltungsrat

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

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

Dr. Thomas Fischer, Mitglied (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		510'000'773.81	344'198'099.48	282'392'649.49	87'882'141.95
<b>Klasse NT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		435'725'093.38	287'172'887.07	229'370'619.40	62'753'103.87
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'937'553.481	2'164'385.814	1'427'573.520	490'400.069
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		148.3292	132.6810	160.6717	127.9631
Thesaurierung je Anteil		2.88	2.88	2.33	2.13
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.02 %	0.02 %	0.02 %	0.03 %
<b>Klasse VT CHF</b>					
	<b>CHF</b>				
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		74'275'680.43	57'025'212.41	53'022'030.09	25'129'038.08
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		636'733.399	544'440.119	416'446.415	246'878.207
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode <sup>1)</sup>		116.6511	104.7410	127.3202	101.7872
Thesaurierung je Anteil		1.82	1.81	1.39	1.50
Total Expense Ratio (Synthetische TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.41 %

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)	11.79 %	-17.44 %	19.68 %	41.44 %
Klasse VT CHF (Lancierung 12.03.2020)	11.37 %	-17.75 %	19.23 %	41.01 %

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	27'772.66	827'055.38
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	513'114'530.49	341'739'230.94
Derivative Finanzinstrumente	-873'476.64	-826'218.11
Sonstige Vermögenswerte	3'196'157.47	2'476'664.71
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>515'464'983.98</b>	<b>344'216'732.92</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-5'441'438.20	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-22'771.97	-18'633.44
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>	<b>510'000'773.81</b>	<b>344'198'099.48</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		2'164'385.814	1'427'573.520
Ausgegebene Anteile		983'691.678	988'214.759
Zurückgenommene Anteile		-210'524.011	-251'402.465
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>2'937'553.481</b>	<b>2'164'385.814</b>
<b>Klasse VT CHF</b>			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		544'440.119	416'446.415
Ausgegebene Anteile		148'407.127	190'836.519
Zurückgenommene Anteile		-56'113.847	-62'842.815
<b>Bestand am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>636'733.399</b>	<b>544'440.119</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		344'198'099.48	282'392'649.49
Saldo aus dem Anteilverkehr		122'918'178.85	132'171'711.97
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		42'884'495.48	-70'366'261.98
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>510'000'773.81</b>	<b>344'198'099.48</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		130.46	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		-0.48	-342.15
Erträge der Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		9'474'690.18	7'076'184.92
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		612'037.64	525'843.32
<b>Total Ertrag</b>		<b>10'086'857.80</b>	<b>7'601'686.09</b>
<b>Aufwand</b>			
Passivzinsen		-5'472.31	-6'423.40
Reglementarische Vergütungen		-264'358.68	-224'730.53
Sonstige Aufwendungen		-2'464.90	-3'913.15
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		-187'004.51	-139'992.57
<b>Total Aufwand</b>		<b>-459'300.40</b>	<b>-375'059.65</b>
<b>Nettoertrag / Verlust</b>		<b>9'627'557.40</b>	<b>7'226'626.44</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		157'175.21	-5'992'097.18
Einkünfte aus Ausgabe-/Rücknahmespesen		124'856.58	135'926.97
<b>Realisierter Erfolg</b>		<b>9'909'589.19</b>	<b>1'370'456.23</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		32'974'906.29	-71'736'718.21
<b>Gesamterfolg</b>		<b>42'884'495.48</b>	<b>-70'366'261.98</b>

## Verwendung des Erfolges

	30.09.2023	30.09.2022
<b>Klasse NT CHF</b>		
Nettoertrag	8'463'041.86	6'240'412.47
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>8'463'041.86</b>	<b>6'240'412.47</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	8'463'041.86	6'240'412.47
<b>Total</b>	<b>8'463'041.86</b>	<b>6'240'412.47</b>
<b>Klasse VT CHF</b>		
Nettoertrag	1'164'515.54	986'213.97
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>1'164'515.54</b>	<b>986'213.97</b>
Thesaurierung: Nettobetrag zur Wiederanlage	1'164'515.54	986'213.97
<b>Total</b>	<b>1'164'515.54</b>	<b>986'213.97</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>513'114'530.49</b>	<b>99.54</b>	
<b>Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen</b>							<b>513'114'530.49</b>	<b>99.54</b>	
CH0117044658	SWC (CH) INDEX EF EUROPE EX CH NT CHF	137'109	23'452	29'791	130'770 CHF	141.36	18'485'903.86	3.59	a)
CH0117044831	SWC (CH) INDEX EF PACIFIC EX JAPAN NT CHF	32'331	11'937	336	43'932 CHF	119.79	5'262'545.54	1.02	a)
CH0117044864	SWC (CH) INDEX EF CANADA NT	33'598	11'635	0	45'233 CAD	178.40	5'460'119.54	1.06	a)
CH0117052545	SWC (CH) INDEX REF SWITZERLAND INDIRECT NT CHF	58'289	28'498	5'137	81'651 CHF	156.48	12'776'349.81	2.48	a)
CH0132501898	SWC (CH) INDEX EF SMALL & MID CAPS SWITZERLAND NT	170'161	63'058	3'558	229'662 CHF	291.54	66'955'737.35	12.99	a)
CH0215804714	SWC (CH) INDEX EF LARGE CAPS SWITZERLAND NT CHF	294'283	114'191	6'476	401'998 CHF	152.93	61'477'892.56	11.93	a)
CH0414225430	SWC (CH) IPF I INDEX EF USA ST USD	573	101	124	550 USD	169'781.65	85'409'339.90	16.57	a)
CH0451461963	SWC (CH) IX EF SWITZERLAND TOTAL RESP. NT CHF	137'341	51'738	2'141	186'937 CHF	136.78	25'569'646.05	4.96	a)
CH0465056536	SWC (CH) IX PMF GOLD PHYS HDGD NTH1 CHF	72'498	26'736	3'507	95'728 CHF	127.43	12'198'727.53	2.37	a)
CH0512828978	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN ST	90	15	18	87 JPY	14'484'538.68	7'722'602.71	1.50	a)
CH0527913138	SWC (CH) IPF I INDEX EF WORLD EX CH RESP. ST CHF	181	37	219	0 CHF	0.00	0.00	0.00	
CH0527915919	SWC(CH)IPF I INDEX EF SMALL CAP WORLD EX CH ST CHF	239	109	5	343 CHF	150'427.96	51'595'587.20	10.01	a)
CH0527916826	SWC (CH) IPF III INDEX EF MSCI® WORLD EX CH ST CHF	120	41	0	161 CHF	158'933.51	25'584'480.06	4.96	a)
CH0561458693	SWC (CH) IEF EMERGING MARKETS RESPONSIBLE NT CHF	400'270	192'471	4'731	588'009 CHF	87.87	51'667'151.07	10.02	a)
CH1223982641	SWC (CH) IPF I IEF USA RESPONSIBLE ST USD	0	330	0	330 USD	113'492.92	34'277'372.80	6.65	a)
CH1223983292	SWC (CH) IPF I IEF JAPAN RESPONSIBLE ST	0	41	0	41 JPY	12'198'074.39	3'035'776.41	0.59	a)
CH1224244850	SWC (CH) IEF EUROPE (EX CH) RESPONSIBLE ST CHF	0	64	0	64 CHF	112'187.40	7'152'059.22	1.39	a)
CH1253521194	SWC (CH) IPF III INDEX EF MSCI® WORLD EX CH NA CHF	0	353'842	3'599	350'244 CHF	109.88	38'483'238.88	7.47	a)
<b>CH</b>							<b>513'114'530.49</b>	<b>99.54</b>	
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>							<b>-873'476.64</b>	<b>-0.17</b>	
<b>Devisentermingeschäfte</b>									
	USD/CHF	Verfall	02.11.2022	93'976'076	96'414'000		CHF/USD	0.00	0.00
	EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	10'637'477	11'093'000		CHF/EUR	0.00	0.00
	GBP/CHF	Verfall	02.11.2022	5'454'453	5'011'000		CHF/GBP	0.00	0.00
	JPY/CHF	Verfall	02.11.2022	7'927'022	1'170'422'000		CHF/JPY	0.00	0.00
	AUD/CHF	Verfall	02.11.2022	2'765'070	4'365'000		CHF/AUD	0.00	0.00
	CAD/CHF	Verfall	02.11.2022	4'588'966	6'444'000		CHF/CAD	0.00	0.00
	SEK/CHF	Verfall	02.11.2022	1'181'777	13'470'000		CHF/SEK	0.00	0.00
	DKK/CHF	Verfall	02.11.2022	928'132	7'198'000		CHF/DKK	0.00	0.00
	NOK/CHF	Verfall	02.11.2022	276'622	3'022'000		CHF/NOK	0.00	0.00
	HKD/CHF	Verfall	02.11.2022	999'819	8'037'000		CHF/HKD	0.00	0.00
	SGD/CHF	Verfall	02.11.2022	472'401	693'000		CHF/SGD	0.00	0.00
	USD/CHF	Verfall	02.11.2022	287'776	294'000		CHF/USD	0.00	0.00
	USD/CHF	Verfall	02.11.2022	386'496	393'000		CHF/USD	0.00	0.00
	USD/CHF	Verfall	02.11.2022	134'391	135'000		CHF/USD	0.00	0.00
	DKK/CHF	Verfall	02.11.2022	3'253	25'000		CHF/DKK	0.00	0.00
	EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	36'780	38'000		CHF/EUR	0.00	0.00
	GBP/CHF	Verfall	02.11.2022	18'771	17'000		CHF/GBP	0.00	0.00
	SEK/CHF	Verfall	02.11.2022	4'041	46'000		CHF/SEK	0.00	0.00
	GBP/CHF	Verfall	02.11.2022	4'417	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00
	USD/CHF	Verfall	02.11.2022	38'878	39'000		CHF/USD	0.00	0.00
	EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	9'683	10'000		CHF/EUR	0.00	0.00
	JPY/CHF	Verfall	02.11.2022	4'058	600'000		CHF/JPY	0.00	0.00
	EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	48'914	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00
	GBP/CHF	Verfall	02.11.2022	24'815	22'000		CHF/GBP	0.00	0.00
	SEK/CHF	Verfall	02.11.2022	5'332	60'000		CHF/SEK	0.00	0.00
	USD/CHF	Verfall	02.11.2022	157'309	157'000		CHF/USD	0.00	0.00
	DKK/CHF	Verfall	02.11.2022	4'341	33'000		CHF/DKK	0.00	0.00
	EUR/CHF	Verfall	02.11.2022	46'046	47'000		CHF/EUR	0.00	0.00
	DKK/CHF	Verfall	02.11.2022	4'082	31'000		CHF/DKK	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.
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		30'347	42'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2022		5'065	40'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		13'775	22'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		77'506	78'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		4'671	700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.11.2022		5'108	57'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		22'500	20'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.11.2022		17'790	28'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.11.2022		6'371	50'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.11.2022		25'608	26'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.11.2022		30'107	4'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.11.2022		12'456	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.11.2022		31'445	43'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		109'996	110'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		2'983'317	4'670'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		4'974'093	6'807'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		1'032'737	7'758'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		99'560'215	99'910'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		1'321'126	14'542'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		486'734	690'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		11'985'239	12'094'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		5'924'623	5'136'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		938'759	7'390'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		8'269'606	1'224'822'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.12.2022		310'015	3'227'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		396'793	402'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		7'391	59'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		61'414	62'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		22'479	35'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		6'777	74'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		3'514	5'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		5'327	40'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		161'135	164'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		36'604	50'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		30'694	27'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		16'247	2'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		244'246	253'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		3'416	500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		11'280	10'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		22'635	23'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		257'735	273'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		211'466	224'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		4'745	36'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		6'209	69'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		24'351	3'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		161'890	172'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		26'875	24'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		4'243	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		55'881	57'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		167'842	176'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		6'648	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		30'656	32'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		4'523	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		10'772	11'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		124'674	131'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		9'773	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		4'545	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		26'366	28'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		7'549	57'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		4'813	7'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		277'241	293'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		61'560	87'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		10'408	86'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		9'896	109'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		89'621	91'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		43'488	38'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		89'045	13'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		31'930	50'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		25'916	41'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		8'459	70'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		5'681	43'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		7'481	83'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		40'088	57'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		31'848	28'000	CHF/GBP		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.
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		491'220	500'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		1'889'528	2'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.12.2022		4'119	6'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		78'978	11'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.12.2022		6'089	50'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.12.2022		498'411	524'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.12.2022		49'515	7'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.12.2022		30'130	43'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.12.2022		30'818	27'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.12.2022		18'511	29'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.12.2022		5'564	42'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.12.2022		7'037	78'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.12.2022		66'007	67'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		103'603'113	109'332'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		13'516'535	13'737'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		6'392'008	5'626'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		3'380'718	5'310'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		5'280'524	7'560'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		1'419'493	15'776'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2023		324'587	3'422'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		1'153'205	8'722'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		1'062'785	8'757'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		556'269	805'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		3'610	30'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		463'454	495'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		10'680	17'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		4'929	5'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		444'354	475'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		4'123	6'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		4'247	47'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		18'261	16'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		40'434	41'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		443'282	475'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		3'447	26'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		5'734	48'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		17'164	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		37'326	38'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		86'490	93'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		10'235	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		3'169	24'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		17'079	27'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		3'876	43'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		15'022	22'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		21'650	22'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		45'740	49'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		3'120	26'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		10'303	9'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		8'817	14'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		7'409	56'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		85'640	87'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		20'464	30'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		132'977	144'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		40'105	35'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		9'062	100'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		6'958	11'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		68'493	74'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		17'680	18'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		8'003	7'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		448'286	484'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		12'457	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		28'653	29'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		29'221	43'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		264'208	284'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		5'108	57'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		4'254	32'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		22'623	20'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		11'191	18'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		4'064	34'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		48'459	49'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		613'835	659'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		4'565	51'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		20'350	18'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		3'847	29'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		43'417	44'000	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.
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		13'580	20'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		6'934	78'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		5'955	45'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		31'424	28'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		431'565	467'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		4'747	40'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		12'942	21'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		65'961	67'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		16'153	26'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		4'893	55'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		5'937	50'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		46'190	47'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		256'178	277'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		25'816	38'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		21'287	19'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		4'229	32'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		5'605	63'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		359'624	387'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		25'719	23'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		6'557	55'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		18'007	29'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		4'905	37'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		27'217	40'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		54'227	55'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		74'806	109'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		7'593	11'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		4'498	4'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		17'086	143'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		8'912	9'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		369'135	396'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		47'486	76'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.01.2023		6'876	10'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.01.2023		62'113	91'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		157'674	160'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.01.2023		14'878	125'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.01.2023		3'752	40'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.01.2023		41'364	66'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		74'801	67'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		14'309	108'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		1'101'858	1'188'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		16'423	185'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.01.2023		294'539	319'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.01.2023		7'152	54'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		36'727	33'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.01.2023		8'124	92'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		78'794	80'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		9'362'145	1'363'222'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		7'565	1'100'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		6'859	1'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		46'443	6'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		15'671	2'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		15'761	2'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		22'595	3'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		3'375	500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		35'475	5'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		4'769	700'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		45'097	6'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		33'694	4'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		50'652	7'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		143'316	20'400'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.01.2023		112'728	16'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		5'318'858	7'823'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		3'543'829	5'662'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		598'005	872'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		1'448'212	16'399'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2023		335'816	3'596'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		1'294'879	10'956'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		9'836'617	1'404'222'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		103'306'024	112'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		6'659'188	5'993'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		13'909'461	14'140'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		1'276'618	9'650'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		118'024	105'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		22'355	168'000		CHF/DKK	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 02.02.2023		301'220	322'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		244'377	247'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2023		5'875	63'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		25'582	288'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		12'976	98'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		14'751	167'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		10'809	17'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		141'772	144'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.02.2023		3'309	36'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		36'628	5'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		907'337	979'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		4'033	34'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		13'019	19'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		68'132	61'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		21'681	22'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		203'875	218'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		8'260	12'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		10'008	9'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		6'310	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		14'715	2'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		7'295	55'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		5'628	800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		8'091	92'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		78'909	80'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		513'875	552'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		36'947	33'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		447'144	488'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		94'982	96'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		285'481	310'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		5'530	8'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		78'239	11'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		34'248	54'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		9'724	110'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		43'650	39'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		12'630	107'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		8'514	64'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		47'288	69'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		3'208	5'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		9'825	1'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		8'205	61'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		93'092	93'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'137'982	1'225'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		42'824	38'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		9'490	107'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		5'534	8'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		31'491	4'400'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		4'510	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		10'032	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		6'491	7'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		11'762	17'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		7'721	12'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		1'849'320	2'000'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		32'620	33'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		14'702	13'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		5'482	47'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		15'346	24'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		23'706	26'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		24'489	36'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		3'470	39'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		28'453	4'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		395'690	432'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		16'985	15'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		3'802	43'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		3'057	23'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		36'589	37'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		4'283	600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		4'423	33'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		8'314	13'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		272'302	296'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		3'058	26'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		22'762	20'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		30'481	4'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		50'846	51'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		5'180	58'000	CHF/SEK		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.
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		11'650	17'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		35'130	35'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		4'553	7'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		15'906	14'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		7'595	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		13'483	1'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		694'594	753'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		3'613	40'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		37'917	55'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		14'804	13'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		3'214	36'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		11'059	12'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		45'936	6'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		32'015	32'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.02.2023		33'918	49'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.02.2023		7'730	11'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.02.2023		73'146	10'300'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.02.2023		49'745	76'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.02.2023		29'650	26'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.02.2023		17'211	146'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.02.2023		6'786	76'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.02.2023		135'650	147'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.02.2023		66'030	66'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.02.2023		5'649	42'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		117'472'752	127'102'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		16'513'057	16'489'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		7'490'111	6'573'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		10'819'042	1'519'522'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		6'000'478	8'717'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		4'041'420	6'220'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 02.03.2023		348'375	3'765'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		1'386'812	10'299'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		1'670'197	18'799'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 02.03.2023		661'053	941'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.03.2023		1'418'239	12'015'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		3'208	24'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		12'961	19'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 02.03.2023		3'592	31'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		36'783	37'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		16'741	15'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		3'785	43'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		10'323	16'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		156'058	172'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		25'522	3'600'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		76'336	83'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		4'934	5'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		14'816	15'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		7'586	11'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		6'718	6'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		73'660	80'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		5'136	8'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		13'891	2'000'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		8'235	12'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		36'238	39'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		20'032	2'900'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 02.03.2023		5'705	9'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		450'984	480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 02.03.2023		71'522	72'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 02.03.2023		6'273	47'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 02.03.2023		7'382	82'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 02.03.2023		12'393	1'800'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 02.03.2023		32'677	29'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.03.2023		317'633	339'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 02.03.2023		4'144	6'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		1'721'922	19'100'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		117'295'613	125'452'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		7'577'834	6'731'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		16'556'346	16'672'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		10'495'744	1'528'922'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		1'316'229	11'026'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		1'462'272	10'960'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		5'897'286	8'576'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		3'839'747	6'116'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		636'178	918'000		CHF/SGD	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.
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		351'565	3'885'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		24'866	3'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		197'987	211'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		8'059	90'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		42'768	62'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		34'794	31'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		6'837	51'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		13'647	114'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		77'790	78'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		97'870	14'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		39'178	62'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		6'271	9'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		6'712	6'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		62'013	99'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.04.2023		21'696	183'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		13'918	14'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		8'922	1'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		154'289	166'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		4'780	7'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 04.04.2023		10'372	15'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		290'695	310'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		4'456	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		9'942	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		142'172	156'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		432'418	469'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		87'223	94'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		76'535	68'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		15'255	115'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 04.04.2023		3'465	40'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		1'009'405	1'089'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		3'370	5'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		173'812	176'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		17'670	200'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		59'800	8'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		81'503	89'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		5'354	40'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		6'135	69'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		60'833	61'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		201'536	219'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		26'095	23'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		99'863	14'200'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		591'786	644'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 04.04.2023		46'674	69'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 04.04.2023		102'011	14'700'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 04.04.2023		10'858	123'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 04.04.2023		4'300	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 04.04.2023		10'156	76'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 04.04.2023		48'647	43'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 04.04.2023		110'504	111'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 04.04.2023		286'675	314'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		1'684'297	19'105'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		1'561'252	11'696'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.05.2023		654'232	953'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2023		1'337'699	11'506'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		5'760'549	8'559'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		3'731'155	6'113'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.05.2023		338'485	3'858'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		119'987'843	131'670'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		17'209'656	17'308'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		7'573'815	6'708'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		427'662	470'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		6'406	73'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.05.2023		23'681	35'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		65'489	66'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.05.2023		5'225	45'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		5'994	45'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		28'217	25'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.05.2023		14'826	24'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.05.2023		27'189	24'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		98'603	109'000	CHF/USD		0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.05.2023		59'627	60'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.05.2023		6'178	70'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.05.2023		5'338	40'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.05.2023		131'292	148'000	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 03.05.2023		99'047	111'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		213'517	238'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		301'199	336'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023		180'959	184'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2023		80'234	72'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.05.2023		16'103	122'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.05.2023		17'483	201'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		226'998	253'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		24'105	27'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		145'946	164'000	CHF/USD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 03.05.2023		3'566	41'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		225'964	252'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 03.05.2023		15'652	14'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 03.05.2023		3'312	25'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 03.05.2023		35'545	36'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 08.05.2023		11'146'067	1'620'122'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 08.05.2023		43'500	6'300'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 08.05.2023		39'966	5'800'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 08.05.2023		56'996	8'500'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 08.05.2023		20'063	3'000'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		121'946'375	136'792'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		18'125'035	18'445'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		11'197'233	1'697'322'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		8'045'703	7'226'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		5'797'630	8'869'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
HKD/CHF	Verfall 02.06.2023		1'334'429	11'733'000	CHF/HKD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.06.2023		1'791'643	20'667'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
DKK/CHF	Verfall 02.06.2023		1'642'923	12'463'000	CHF/DKK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		3'812'064	6'477'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
NOK/CHF	Verfall 02.06.2023		347'502	4'153'000	CHF/NOK		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		217'605	246'000	CHF/USD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		20'375	3'100'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.06.2023		3'113	36'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		89'620	138'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		13'312	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		6'499	11'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		31'337	32'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		9'115	14'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		17'235	2'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		12'236	11'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		189'229	214'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		27'276	28'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		5'904	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		193'166	217'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		319'532	360'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		159'145	179'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		5'976	9'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		10'568	1'600'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		4'208	7'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		9'752	10'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		4'489	4'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		19'197	2'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		381'432	430'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		13'436	12'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		29'231	30'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		9'957	15'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 02.06.2023		2'952	34'000	CHF/SEK		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 02.06.2023		6'002	10'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		318'622	357'000	CHF/USD		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 02.06.2023		10'068	9'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		169'843	190'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 02.06.2023		23'332	24'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 02.06.2023		25'668	3'900'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		76'329	85'000	CHF/USD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		103'626	115'000	CHF/USD		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 02.06.2023		50'037	75'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
SGD/CHF	Verfall 05.06.2023		655'917	983'000	CHF/SGD		0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.07.2023		130'158'081	143'475'000	CHF/USD		0.00	0.00	
EUR/CHF	Verfall 05.07.2023		17'927'191	18'467'000	CHF/EUR		0.00	0.00	
GBP/CHF	Verfall 05.07.2023		7'988'979	7'114'000	CHF/GBP		0.00	0.00	
JPY/CHF	Verfall 05.07.2023		11'927'380	1'826'722'000	CHF/JPY		0.00	0.00	
CAD/CHF	Verfall 05.07.2023		5'980'020	8'984'000	CHF/CAD		0.00	0.00	
AUD/CHF	Verfall 05.07.2023		3'780'942	6'424'000	CHF/AUD		0.00	0.00	
SEK/CHF	Verfall 05.07.2023		1'743'284	20'961'000	CHF/SEK		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.
	NOK/CHF Verfall 05.07.2023		331'989	4'110'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.07.2023		1'681'363	12'902'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.07.2023		1'273'353	10'984'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.07.2023		654'157	976'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		134'159'299	149'721'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		17'906'125	18'361'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.08.2023		12'211'137	1'963'622'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		7'879'341	6'952'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		3'800'293	6'395'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		6'041'337	8'932'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.08.2023		336'333	4'029'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		1'718'281	20'772'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		1'610'678	12'293'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		635'964	961'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		1'263'430	11'043'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		224'375	262'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		158'799	185'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		127'195	147'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		94'019	109'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		59'900	91'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.08.2023		21'205	19'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.08.2023		4'555	55'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.08.2023		251'902	290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		41'495	71'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.08.2023		4'357	34'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		6'532	10'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		13'357	120'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.08.2023		47'744	50'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.08.2023		16'940	26'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.08.2023		138'964	212'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.08.2023		101'827	176'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 03.08.2023		33'042	297'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		18'442'950	19'273'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		8'087'327	7'256'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		12'186'661	1'987'822'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 05.09.2023		361'243	4'231'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 05.09.2023		6'315'248	9'644'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 05.09.2023		1'308'077	11'769'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		137'807'294	158'935'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 05.09.2023		1'758'691	21'326'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 05.09.2023		4'062'269	6'994'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 05.09.2023		696'951	1'068'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		1'623'981	12'643'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		14'848	17'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		43'487	7'200'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		99'652	114'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		87'531	99'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 05.09.2023		25'511	23'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 05.09.2023		99'430	16'500'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 05.09.2023		6'017	47'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 05.09.2023		60'122	63'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 05.09.2023		631'704	717'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		138'152'227	157'437'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	EUR/CHF Verfall 03.10.2023		18'022'686	18'829'000		CHF/EUR	0.00	0.00	
	JPY/CHF Verfall 03.10.2023		12'008'536	1'987'122'000		CHF/JPY	0.00	0.00	
	GBP/CHF Verfall 03.10.2023		7'863'930	7'050'000		CHF/GBP	0.00	0.00	
	AUD/CHF Verfall 03.10.2023		3'848'419	6'759'000		CHF/AUD	0.00	0.00	
	CAD/CHF Verfall 03.10.2023		6'216'811	9'588'000		CHF/CAD	0.00	0.00	
	NOK/CHF Verfall 03.10.2023		351'830	4'263'000		CHF/NOK	0.00	0.00	
	SEK/CHF Verfall 03.10.2023		1'630'282	20'195'000		CHF/SEK	0.00	0.00	
	DKK/CHF Verfall 03.10.2023		1'772'935	13'805'000		CHF/DKK	0.00	0.00	
	SGD/CHF Verfall 03.10.2023		675'115	1'038'000		CHF/SGD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		259'329	284'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 03.10.2023		185'113	202'000		CHF/USD	0.00	0.00	
	HKD/CHF Verfall 04.10.2023		1'199'303	10'703'000		CHF/HKD	0.00	0.00	
	USD/CHF Verfall 02.11.2023		134'062'452	147'868'000		CHF/USD	-739'675.32	-0.14	b)
	EUR/CHF Verfall 02.11.2023		16'845'269	17'493'000		CHF/EUR	-61'793.29	-0.01	b)
	GBP/CHF Verfall 02.11.2023		8'006'496	7'209'000		CHF/GBP	-16'187.71	0.00	b)
	JPY/CHF Verfall 02.11.2023		12'401'852	2'024'422'000		CHF/JPY	-31'441.12	-0.01	b)
	AUD/CHF Verfall 02.11.2023		3'846'390	6'539'000		CHF/AUD	-5'386.00	0.00	b)
	CAD/CHF Verfall 02.11.2023		6'131'541	9'090'000		CHF/CAD	-557.39	0.00	b)
	NOK/CHF Verfall 02.11.2023		378'013	4'427'000		CHF/NOK	-1'610.75	0.00	b)
	HKD/CHF Verfall 02.11.2023		1'141'252	9'845'000		CHF/HKD	-5'105.86	0.00	b)
	SGD/CHF Verfall 02.11.2023		680'372	1'020'000		CHF/SGD	-1'863.99	0.00	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.
	SEK/CHF Verfall 02.11.2023		1'621'085	19'344'000		CHF/SEK	-4'309.77	0.00	b)
	DKK/CHF Verfall 02.11.2023		1'710'581	13'236'000		CHF/DKK	-5'545.44	0.00	b)
<b>Devisentermingeschäfte</b>							<b>-873'476.64</b>	<b>-0.17</b>	

<b>Vermögensaufstellung</b>		Kurswert CHF	in % 7)
Bankguthaben auf Sicht		27'772.66	0.01
Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen		513'114'530.49	99.54
Derivative Finanzinstrumente		-873'476.64	-0.17
Sonstige Vermögenswerte		3'196'157.47	0.62
<b>Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>515'464'983.98</b>	<b>100.00</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten		-5'441'438.20	
Andere Verbindlichkeiten		-22'771.97	
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode</b>		<b>510'000'773.81</b>	

<b>Bewertungskategorien</b>		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);	513'114'530.49	99.54
b)	Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind; bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	-873'476.64	-0.17
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	188'245'458.29	36.911

## 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 - 0.10	-	0.071	0.00 - 0.04	-	0.001
VT CHF	CHF	0.00 - 0.10	-	0.071	0.00 - 0.04	-	0.001

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	2.880	-	2.880
VT CHF 34)	Nein	CHF	1.828	-	1.828

## 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 Anteilsklassen 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



**Mitteilung an die Anleger**  
des  
**Swisscanto (CH) Institutional Pension Fund III (IPF III)**  
ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts  
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen" für qualifizierte Anleger  
(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, den Fondsvertrag des Umbrella-Fonds, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, zu ändern.

Im Fondsvertrag erfolgt bei einzelnen Anteilsklassen eine Anpassung betreffend den Anlegerkreis.

Neben den nachfolgend umschriebenen Änderungen des Fondsvertrags werden einzelne Anpassungen des Fondsvertrags formeller Natur vorgenommen.

### **Anpassung Anlegerkreis von Anteilsklassen**

Bei den Anteilsklassen GA CHF, GA EUR, GA GBP, GA USD, GAH1 CHF, GAH1 EUR, GAH1 GBP, GAH1 USD, NA CHF, NA EUR, NA GBP, NA USD, NAH1 CHF, NAH1 EUR, NAH1 GBP und NAH1 USD wird in § 6 Ziff. 4 des Fondsvertrags im Anlegerkreisbeschrieb der jeweiligen Anteilsklasse die Ausführung, dass die Anteilsklasse nicht von bzw. für kollektive Kapitalanlagen erworben bzw. von kollektiven Kapitalanlagen gehalten werden dürfen, gestrichen.

\*\*\*

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 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 Fondsvertrags erstreckt.

Die 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 Fondsvertrags

Einwendungen erheben oder die Auszahlung ihrer Anteile gemäss den Rücknahmebestimmungen des Fondsvertrags 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, 15. September 2022

**Die Fondsleitung:**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Zürich

**Die Depotbank:**

Zürcher Kantonalbank  
Zürich