

ZKB GOLD ETF

Jahresbericht per 30.09.2023

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

Klasse	Valor	Währung
AA CHF	13910159	CHF
AA EUR	4753352	EUR
AA GBP	10449329	GBP
AA USD	4753354	USD
AAH CHF	13910160	CHF
AAH EUR	10332676	EUR
AAH GBP	10449330	GBP

Rechnungswährung: CHF

Weitere Informationen stehen im Internet unter www.swisscanto-fondsleitungen.com zur Verfügung.

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich, 26.01.2024

An den Verwaltungsrat der
Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Zürich, 26. Januar 2024

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds ZKB Gold ETF, bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2023, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigefügte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt



Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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



Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung

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



Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt.

Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

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

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

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

Ernst & Young AG

Patrick Schwaller
Zugelassener Revisionsexperte
(Leitender Revisor)

Yves Lauber
Zugelassener Revisionsexperte

Beilage

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

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Verwaltung	2
2	Vertriebsorganisation	3
3	Abschlusszahlen	4
4	Derivative Finanzinstrumente - Risiko gemäss Commitment I	19
5	Spesen zu Gunsten Teilvermögen und Kommissionen zu Gunsten Fondsleitung	20
6	Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte	20
7	Pauschale Verwaltungskommission	21
8	Benchmark	21
9	TER	21
10	Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023	22
11	Fussnoten	22
12	Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte	23
13	Pflichtpublikationen	24

1 Organisation und Verwaltung

Fondsleitung

Firma Swisscanto Fondsleitung AG
Sitz Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Verwaltungsrat

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

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

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

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

Geschäftsleitung

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

Delegationen

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

Depotbank

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG, Maagplatz 1, 8005 Zürich

2 Vertriebsorganisation

Zahlstelle

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

Vertriebsträger

Zürcher Kantonalbank, Bahnhofstrasse 9, 8001 Zürich

3 Abschlusszahlen

Übersicht

	von	01.10.2022	01.10.2021	01.10.2020	01.10.2019
	bis	30.09.2023	30.09.2022	30.09.2021	30.09.2020
Konsolidiert					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'231'343'803.29	8'238'927'850.54	8'829'096'134.38	9'789'949'471.72
Klasse AA CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		3'795'538'149.38	3'683'491'619.12	3'920'472'612.55	4'217'150'024.95
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		7'411'932.000	7'450'280.000	7'988'346.000	8'023'270.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		512.08	494.41	490.77	525.61
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse AA EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		1'045'697'274.77	1'114'394'362.99	1'170'246'846.70	1'314'481'289.26
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		649'366.000	716'766.000	758'266.000	795'266.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'662.63	1'612.44	1'427.51	1'534.18
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse AA GBP					
GBP					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		18'740'537.30	18'873'592.82	21'986'293.43	27'195'284.88
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		11'600.000	12'100.000	14'200.000	16'400.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'446.91	1'419.66	1'230.97	1'396.11
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse AA USD					
USD					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		1'869'950'128.29	1'915'018'653.74	2'025'946'316.76	2'425'971'477.68
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		1'161'204.000	1'231'704.000	1'312'704.000	1'467'704.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'760.34	1'579.65	1'654.43	1'799.08
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse AAH CHF					
CHF					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		1'157'096'002.25	1'164'391'854.05	1'285'593'608.16	1'343'679'740.65
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		2'666'954.000	2'854'254.000	2'953'254.000	2'795'254.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		433.86	407.95	435.31	480.70
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse AAH EUR					
EUR					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		329'523'324.45	327'539'472.46	386'924'269.93	441'970'795.31
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		344'812.000	372'712.000	369'712.000	385'212.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		986.70	911.41	968.02	1'064.95
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %
Klasse AAH GBP					
GBP					
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode (in CHF)		14'798'386.85	15'218'295.36	17'926'186.85	19'500'858.99
Anzahl Anteile am Ende der Rechnungsperiode		13'250.000	15'200.000	14'900.000	15'700.000
Nettoinventarwert je Anteil am Ende der Rechnungsperiode ¹⁾		1'000.27	911.25	956.50	1'045.74
Total Expense Ratio (TER)		0.40 %	0.40 %	0.40 %	0.40 %

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 AA CHF	3.57 %	1.53 %	-1.82 %	13.30 %
Klasse AA EUR	3.11 %	6.54 %	2.49 %	13.86 %
Klasse AA GBP	1.92 %	12.58 %	-3.87 %	20.28 %
Klasse AA USD	11.44 %	-0.02 %	-4.75 %	24.11 %
Klasse AAH CHF	6.35 %	-2.82 %	-6.03 %	21.38 %
Klasse AAH EUR	8.26 %	-2.18 %	-5.64 %	21.59 %
Klasse AAH GBP	9.77 %	-0.87 %	-4.91 %	22.14 %

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	842'522.48	869'152.09
Andere Anlagen - Edelmetalle	8'238'373'331.29	8'246'281'422.77
Derivative Finanzinstrumente	423'041.13	371'550.32
Sonstige Vermögenswerte	567.16	0.00
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	8'239'639'462.06	8'247'522'125.18
Andere Verbindlichkeiten	-8'295'658.77	-8'594'274.64
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	8'231'343'803.29	8'238'927'850.54

Entwicklung der Anzahl Anteile

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Klasse AA CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		7'450'280.000	7'988'346.000
Ausgegebene Anteile		263'000.000	114'000.000
Zurückgenommene Anteile		-300'000.000	-648'000.000
Zurückgenommene Anteile (Sachauslagen)		-1'348.000	-4'066.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		7'411'932.000	7'450'280.000
Klasse AA EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		716'766.000	758'266.000
Ausgegebene Anteile		5'000.000	25'000.000
Zurückgenommene Anteile		-72'400.000	-66'500.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		649'366.000	716'766.000
Klasse AA GBP			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		12'100.000	14'200.000
Ausgegebene Anteile		1'000.000	1'700.000
Zurückgenommene Anteile		-1'500.000	-3'800.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		11'600.000	12'100.000
Klasse AA USD			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		1'231'704.000	1'312'704.000
Ausgegebene Anteile		10'000.000	38'000.000
Zurückgenommene Anteile		-80'500.000	-119'000.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		1'161'204.000	1'231'704.000
Klasse AAH CHF			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		2'854'254.000	2'953'254.000
Ausgegebene Anteile		50'000.000	50'000.000
Zurückgenommene Anteile		-237'300.000	-149'000.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		2'666'954.000	2'854'254.000
Klasse AAH EUR			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		372'712.000	369'712.000
Ausgegebene Anteile		25'400.000	29'700.000
Zurückgenommene Anteile		-53'300.000	-26'700.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		344'812.000	372'712.000
Klasse AAH GBP			
Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode		15'200.000	14'900.000
Ausgegebene Anteile		1'800.000	700.000
Zurückgenommene Anteile		-3'750.000	-400.000
Bestand am Ende der Rechnungsperiode		13'250.000	15'200.000

Sachauslagen (Rücknahme von Anteilen)

	Datum	Gegenwert	Anteile
Klasse AA CHF	14.11.2022	677'302.60	1'348.000

Veränderung des Nettofondsvermögens

	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Konsolidiert			
Nettofondsvermögen zu Beginn der Rechnungsperiode		8'238'927'850.54	8'829'096'134.38
Saldo aus dem Anteilverkehr		-367'508'651.52	-506'672'637.40
Gesamterfolg aus Erfolgsrechnung		359'924'604.27	-83'495'646.44
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode		8'231'343'803.29	8'238'927'850.54

Erfolgsrechnung

Konsolidiert	von bis	01.10.2022 30.09.2023	01.10.2021 30.09.2022
Ertrag			
Erträge der Bankguthaben auf Sicht		1'939.79	0.00
Negativzinsen aus Bankguthaben auf Sicht		0.00	-4'474.54
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen		-205'577.90	-412'946.97
Total Ertrag		-203'638.11	-417'421.51
Aufwand			
Passivzinsen		-3'167.21	0.00
Reglementarische Vergütungen		-34'148'012.50	-36'017'012.03
Sonstige Aufwendungen		-1'287.15	0.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen		1'087'717.68	1'540'367.81
Total Aufwand		-33'064'749.18	-34'476'644.22
Nettoertrag / Verlust		-33'268'387.29	-34'894'065.73
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste		292'993'834.76	135'786'359.40
Realisierter Erfolg		259'725'447.47	100'892'293.67
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste		100'199'156.80	-184'387'940.11
Gesamterfolg		359'924'604.27	-83'495'646.44

Verwendung des Erfolges

Klasse AA CHF			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-15'284'093.05	-15'407'002.50	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	15'284'093.05	15'407'002.50	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	
Klasse AA EUR			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-4'210'874.14	-4'661'195.20	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	4'210'874.14	4'661'195.20	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	
Klasse AA GBP			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-75'465.51	-78'942.94	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	75'465.51	78'942.94	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	
Klasse AA USD			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-7'530'023.51	-8'009'980.79	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	7'530'023.51	8'009'980.79	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	
Klasse AAH CHF			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-4'753'231.34	-5'133'718.10	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	4'753'231.34	5'133'718.10	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	
Klasse AAH EUR			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-1'354'457.09	-1'530'004.92	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	1'354'457.09	1'530'004.92	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	
Klasse AAH GBP			
	30.09.2023	30.09.2022	
Nettoertrag	-60'242.65	-73'221.28	
Zuweisung des Verlusts zu den angesammelten Kapitalgewinnen und -verlusten	60'242.65	73'221.28	
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	0.00	0.00	

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.
Andere Anlagen							8'238'373'331.29	99.98	
Edelmetalle									
XD0002811053	GOLDBARREN (1 GRAMM) - 995	155'880'094	17'415'785	23'545'868	149'750'011	CHF	55.01	8'238'373'331.29	99.98 a)
Total Edelmetalle							8'238'373'331.29	99.98	
Derivative Finanzinstrumente							423'041.13	0.01	
Devisentermingeschäfte									
	CHF/EUR Verfall 12.10.2022		2'050'000	1'990'999		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/GBP Verfall 12.10.2022		80'000	88'345		GBP/CHF		0.00	0.00
	GBP/CHF Verfall 15.11.2022		417'722	370'000		CHF/GBP		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 15.11.2022		5'077'027	5'160'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 28.11.2022		2'891'553	2'960'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	GBP/CHF Verfall 28.11.2022		249'898	220'000		CHF/GBP		0.00	0.00
	CHF/GBP Verfall 28.12.2022		45'000	50'402		GBP/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 28.12.2022		980'000	963'402		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/GBP Verfall 29.12.2022		110'000	123'087		GBP/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 29.12.2022		490'000	483'220		EUR/CHF		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 03.01.2023		389'212	395'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 04.01.2023		1'551'655	1'575'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	GBP/CHF Verfall 04.01.2023		27'857	25'000		CHF/GBP		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 18.01.2023		778'605	777'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	GBP/CHF Verfall 18.01.2023		92'683	82'000		CHF/GBP		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 22.02.2023		350'000	346'390		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 09.05.2023		1'960'000	1'912'676		EUR/CHF		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 10.05.2023		147'397	150'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	EUR/CHF Verfall 20.06.2023		449'008	460'000		CHF/EUR		0.00	0.00
	GBP/CHF Verfall 20.06.2023		72'138	63'000		CHF/GBP		0.00	0.00
	CHF/GBP Verfall 06.07.2023		25'000	28'432		GBP/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 06.07.2023		180'000	176'080		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 29.08.2023		325'000	310'686		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 30.08.2023		2'265'000	2'162'978		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/EUR Verfall 06.09.2023		1'530'000	1'462'198		EUR/CHF		0.00	0.00
	CHF/GBP Verfall 06.09.2023		57'000	63'629		GBP/CHF		0.00	0.00
Devisentermingeschäfte							0.00	0.00	
Class Hedge Devisentermingeschäfte 35)									
	USD/CHF Verfall 05.10.2022		1'172'163'637	1'191'130'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 06.10.2022		1'165'693'035	1'176'650'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 07.10.2022		1'192'848'905	1'215'820'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 11.10.2022		1'180'719'703	1'198'120'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 12.10.2022		1'192'989'939	1'206'160'000		CHF/USD		0.00	0.00
	CHF/USD Verfall 12.10.2022		1'206'160'000	1'196'426'289		USD/CHF		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 13.10.2022		1'178'343'218	1'188'040'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 14.10.2022		1'157'403'749	1'160'550'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 17.10.2022		1'163'577'176	1'165'610'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 18.10.2022		1'145'514'936	1'140'850'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 19.10.2022		1'145'339'496	1'141'710'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 20.10.2022		1'156'308'954	1'160'510'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 21.10.2022		1'149'298'858	1'155'260'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 24.10.2022		1'133'004'045	1'128'860'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 25.10.2022		1'132'634'242	1'131'920'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 26.10.2022		1'145'304'204	1'139'520'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 27.10.2022		1'149'615'817	1'148'950'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 28.10.2022		1'157'207'639	1'162'110'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 31.10.2022		1'158'692'443	1'173'760'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 01.11.2022		1'156'976'419	1'168'800'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 02.11.2022		1'148'139'045	1'152'300'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 03.11.2022		1'138'729'763	1'137'890'000		CHF/USD		0.00	0.00
	USD/CHF Verfall 04.11.2022		1'144'836'651	1'145'630'000		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 07.11.2022		1'147'320'737	1'149'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.11.2022		1'134'901'811	1'120'040'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.11.2022		1'166'273'317	1'168'600'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.11.2022		1'165'850'307	1'178'330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.11.2022		1'164'859'502	1'183'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.11.2022		1'193'605'341	1'213'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 15.11.2022		1'213'180'000	1'173'411'960		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.11.2022		1'210'653'899	1'251'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.11.2022		1'227'416'035	1'298'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.11.2022		1'229'292'373	1'300'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.11.2022		1'229'796'460	1'305'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.11.2022		1'222'301'407	1'280'130'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.11.2022		1'210'461'054	1'273'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.11.2022		1'207'043'475	1'258'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.11.2022		1'205'871'423	1'266'520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 28.11.2022		1'266'520'000	1'193'467'126		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.11.2022		1'199'290'213	1'272'840'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.11.2022		1'208'432'546	1'276'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.12.2022		1'208'328'599	1'278'840'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.12.2022		1'208'640'656	1'270'480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.12.2022		1'209'761'361	1'270'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.12.2022		1'244'930'723	1'325'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.12.2022		1'229'659'569	1'306'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.12.2022		1'223'283'691	1'303'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.12.2022		1'221'515'529	1'299'580'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.12.2022		1'229'574'315	1'309'840'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.12.2022		1'233'090'476	1'317'220'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.12.2022		1'240'488'253	1'329'950'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.12.2022		1'247'458'518	1'332'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.12.2022		1'271'000'936	1'372'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.12.2022		1'256'098'587	1'360'290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.12.2022		1'245'015'226	1'340'870'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.12.2022		1'251'472'684	1'342'380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.12.2022		1'248'992'641	1'338'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.12.2022		1'261'833'165	1'363'740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 28.12.2022		1'363'740'000	1'263'409'648		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.12.2022		1'263'862'032	1'364'380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 29.12.2022		1'364'380'000	1'269'582'878		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.01.2023		1'253'074'679	1'347'940'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 03.01.2023		1'347'940'000	1'251'333'140		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.01.2023		1'256'071'364	1'353'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 04.01.2023		1'353'200'000	1'249'585'476		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.01.2023		1'259'401'975	1'363'990'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.01.2023		1'286'616'546	1'371'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.01.2023		1'287'494'373	1'385'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.01.2023		1'273'766'702	1'358'570'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.01.2023		1'279'387'783	1'374'310'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.01.2023		1'302'312'461	1'418'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.01.2023		1'304'888'584	1'413'790'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.01.2023		1'295'827'754	1'392'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.01.2023		1'297'049'302	1'396'650'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 18.01.2023		1'396'650'000	1'293'549'297		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.01.2023		1'311'768'787	1'416'470'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.01.2023		1'318'210'780	1'432'240'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.01.2023		1'325'329'492	1'452'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.01.2023		1'321'087'202	1'440'780'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.01.2023		1'321'560'267	1'435'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.01.2023		1'316'030'156	1'426'240'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.01.2023		1'314'108'921	1'423'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.01.2023		1'326'972'162	1'442'510'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.01.2023		1'329'474'050	1'442'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.02.2023		1'320'955'245	1'431'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.02.2023		1'316'141'752	1'425'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.02.2023		1'310'579'735	1'426'750'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.02.2023		1'312'485'800	1'436'160'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.02.2023		1'310'634'171	1'441'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.02.2023		1'276'410'632	1'383'460'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.02.2023		1'272'538'107	1'371'090'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.02.2023		1'264'874'383	1'369'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.02.2023		1'270'506'225	1'380'040'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.02.2023		1'277'464'213	1'390'090'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.02.2023		1'261'804'751	1'365'560'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.02.2023		1'259'815'697	1'367'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.02.2023		1'265'144'338	1'372'130'000		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 21.02.2023		1'238'858'989	1'338'990'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.02.2023		1'235'604'441	1'334'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 22.02.2023		1'334'390'000	1'237'820'196		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.02.2023		1'240'293'116	1'337'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.02.2023		1'240'028'146	1'339'660'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.02.2023		1'244'851'464	1'339'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.02.2023		1'232'252'437	1'320'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.03.2023		1'222'951'764	1'301'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.03.2023		1'222'164'929	1'304'380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.03.2023		1'228'157'952	1'310'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.03.2023		1'236'338'611	1'316'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.03.2023		1'233'140'990	1'310'000'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.03.2023		1'236'059'265	1'315'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.03.2023		1'240'010'658	1'330'440'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.03.2023		1'228'640'969	1'306'470'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.03.2023		1'215'409'817	1'292'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.03.2023		1'228'928'279	1'312'010'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.03.2023		1'249'738'939	1'359'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.03.2023		1'283'382'458	1'407'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.03.2023		1'275'752'957	1'396'610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.03.2023		1'291'644'111	1'398'030'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.03.2023		1'289'296'805	1'386'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.03.2023		1'315'948'781	1'417'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.03.2023		1'321'099'242	1'425'580'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.03.2023		1'308'197'453	1'416'330'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.03.2023		1'306'145'136	1'414'520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.03.2023		1'324'870'908	1'448'860'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.03.2023		1'333'443'022	1'452'910'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.03.2023		1'303'013'641	1'421'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.03.2023		1'299'470'553	1'411'060'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.04.2023		1'298'433'881	1'412'860'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.04.2023		1'300'316'622	1'424'260'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.04.2023		1'312'673'919	1'437'160'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.04.2023		1'312'306'854	1'438'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.04.2023		1'325'884'943	1'462'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.04.2023		1'345'177'622	1'487'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.04.2023		1'314'317'353	1'453'550'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.04.2023		1'315'154'375	1'455'340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.04.2023		1'321'829'828	1'473'740'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.04.2023		1'339'626'063	1'507'610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.04.2023		1'321'550'101	1'478'540'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.04.2023		1'306'182'158	1'453'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.04.2023		1'302'756'938	1'451'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.04.2023		1'299'573'210	1'446'810'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.04.2023		1'309'562'293	1'465'520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.04.2023		1'281'317'037	1'433'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.04.2023		1'285'621'103	1'446'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.04.2023		1'294'639'082	1'451'250'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.05.2023		1'306'591'200	1'468'080'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.05.2023		1'291'523'771	1'440'110'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.05.2023		1'282'629'979	1'441'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.05.2023		1'289'103'892	1'441'280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.05.2023		1'304'694'830	1'470'880'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 09.05.2023		1'470'880'000	1'304'346'966		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.05.2023		1'323'757'053	1'492'940'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 10.05.2023		1'492'940'000	1'332'777'397		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.05.2023		1'292'675'880	1'448'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.05.2023		1'307'060'259	1'466'660'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.05.2023		1'315'136'552	1'479'610'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.05.2023		1'298'457'169	1'451'890'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.05.2023		1'304'979'231	1'455'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.05.2023		1'302'116'627	1'454'190'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.05.2023		1'294'344'292	1'444'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.05.2023		1'267'568'975	1'409'790'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.05.2023		1'261'094'386	1'397'920'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.05.2023		1'268'208'469	1'410'870'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.05.2023		1'265'675'344	1'406'270'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.05.2023		1'265'624'476	1'399'510'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.05.2023		1'249'207'466	1'380'310'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.06.2023		1'255'464'153	1'384'240'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.06.2023		1'253'969'737	1'387'480'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.06.2023		1'263'055'183	1'382'030'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.06.2023		1'264'899'342	1'392'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.06.2023		1'258'412'547	1'387'110'000		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 08.06.2023		1'254'763'095	1'384'460'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.06.2023		1'253'252'549	1'379'290'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.06.2023		1'263'555'938	1'392'520'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.06.2023		1'259'864'925	1'398'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.06.2023		1'255'748'761	1'392'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.06.2023		1'251'974'093	1'376'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.06.2023		1'249'641'530	1'380'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.06.2023		1'249'435'905	1'392'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.06.2023		1'245'174'564	1'392'530'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 20.06.2023		1'392'530'000	1'244'754'716		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.06.2023		1'253'143'527	1'402'070'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.06.2023		1'233'255'316	1'371'930'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.06.2023		1'224'839'944	1'368'680'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.06.2023		1'227'735'905	1'369'040'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.06.2023		1'234'992'213	1'375'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.06.2023		1'229'152'618	1'373'460'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.06.2023		1'227'515'748	1'370'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.07.2023		1'220'230'559	1'360'140'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.07.2023		1'211'874'924	1'351'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.07.2023		1'221'956'576	1'366'090'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.07.2023		1'366'090'000	1'224'303'519		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.07.2023		1'232'182'922	1'375'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.07.2023		1'228'991'162	1'369'380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.07.2023		1'217'276'710	1'357'430'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.07.2023		1'222'616'592	1'373'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.07.2023		1'227'766'794	1'382'200'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.07.2023		1'232'624'348	1'397'500'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.07.2023		1'241'500'020	1'431'870'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.07.2023		1'247'102'369	1'451'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.07.2023		1'241'278'173	1'443'340'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 20.07.2023		1'242'133'145	1'443'880'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.07.2023		1'256'574'259	1'465'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.07.2023		1'259'748'095	1'466'090'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.07.2023		1'261'846'301	1'458'100'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.07.2023		1'248'521'721	1'441'870'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.07.2023		1'248'946'038	1'442'410'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.07.2023		1'244'034'938	1'436'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.07.2023		1'250'636'191	1'449'450'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.08.2023		1'240'796'952	1'428'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.08.2023		1'243'571'210	1'433'490'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.08.2023		1'252'071'656	1'444'620'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.08.2023		1'229'874'932	1'401'880'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.08.2023		1'227'753'597	1'402'320'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 09.08.2023		1'233'150'799	1'414'300'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 10.08.2023		1'224'134'112	1'399'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.08.2023		1'218'834'448	1'391'690'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.08.2023		1'220'201'892	1'392'400'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.08.2023		1'219'367'004	1'395'770'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 16.08.2023		1'212'699'269	1'385'160'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 17.08.2023		1'206'178'966	1'371'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.08.2023		1'206'852'109	1'377'980'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.08.2023		1'208'051'046	1'374'810'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.08.2023		1'203'897'208	1'370'720'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 23.08.2023		1'203'018'274	1'365'210'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 24.08.2023		1'199'388'683	1'362'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.08.2023		1'200'547'096	1'364'310'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.08.2023		1'216'127'012	1'383'700'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 29.08.2023		1'383'700'000	1'220'686'303		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 30.08.2023		1'216'252'296	1'378'820'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 30.08.2023		1'378'820'000	1'223'137'434		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 31.08.2023		1'220'655'909	1'376'170'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 01.09.2023		1'223'736'665	1'388'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 05.09.2023		1'235'649'877	1'410'020'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 06.09.2023		1'230'599'753	1'393'350'000		CHF/USD	0.00	0.00	
CHF/USD	Verfall 06.09.2023		1'393'350'000	1'231'986'137		USD/CHF	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 07.09.2023		1'230'764'939	1'392'120'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 08.09.2023		1'216'807'245	1'368'510'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 11.09.2023		1'213'696'202	1'359'410'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 12.09.2023		1'210'000'723	1'355'220'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 13.09.2023		1'218'194'376	1'366'280'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 14.09.2023		1'215'175'043	1'363'230'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 15.09.2023		1'204'146'684	1'348'890'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 18.09.2023		1'205'537'715	1'350'850'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 19.09.2023		1'198'201'754	1'339'680'000		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 20.09.2023		1'207'675'964	1'346'630'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 21.09.2023		1'203'450'800	1'340'380'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 22.09.2023		1'210'592'027	1'348'680'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 25.09.2023		1'214'973'096	1'358'680'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 26.09.2023		1'193'243'996	1'321'640'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 27.09.2023		1'199'633'786	1'324'390'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 28.09.2023		1'197'622'701	1'311'310'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 29.09.2023		1'186'142'169	1'298'240'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 02.10.2023		1'169'469'800	1'271'760'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 03.10.2023		1'159'541'266	1'265'180'000		CHF/USD	0.00	0.00	
USD/CHF	Verfall 04.10.2023		1'157'813'500	1'265'850'000		CHF/USD	386'460.36	0.00	b)
Klasse AAH CHF							386'460.36	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.10.2022		339'068'852	332'220'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.10.2022		339'066'769	332'930'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.10.2022		348'182'541	346'720'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.10.2022		344'978'181	340'060'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.10.2022		347'190'897	341'740'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 12.10.2022		341'740'000	349'259'558		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.10.2022		343'163'605	335'800'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.10.2022		337'464'086	327'640'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.10.2022		338'738'334	328'690'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.10.2022		333'477'248	324'020'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.10.2022		333'726'294	325'550'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.10.2022		336'616'247	330'490'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.10.2022		335'285'877	330'270'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.10.2022		330'145'950	323'270'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.10.2022		329'964'784	324'850'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.10.2022		333'496'802	326'760'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.10.2022		333'522'153	329'720'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.10.2022		336'636'715	335'290'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.10.2022		336'948'757	338'680'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.11.2022		337'024'256	336'940'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.11.2022		334'229'866	332'540'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.11.2022		331'884'587	328'010'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.11.2022		333'196'949	329'000'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.11.2022		333'633'252	329'460'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.11.2022		330'320'375	322'340'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.11.2022		339'294'736	335'800'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.11.2022		339'295'901	339'330'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.11.2022		339'113'829	341'490'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.11.2022		347'816'204	348'860'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 15.11.2022		348'860'000	342'614'144		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.11.2022		351'654'719	358'090'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.11.2022		354'687'660	366'500'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.11.2022		356'248'626	369'360'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.11.2022		355'047'380	369'550'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.11.2022		353'088'215	364'720'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.11.2022		350'559'720	363'230'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.11.2022		349'698'080	358'130'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.11.2022		349'087'572	359'120'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 28.11.2022		359'120'000	346'129'750		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.11.2022		348'409'120	361'510'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.11.2022		350'450'902	364'750'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.12.2022		351'061'083	365'070'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.12.2022		348'875'215	361'310'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.12.2022		350'754'871	361'200'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.12.2022		359'295'311	376'830'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.12.2022		354'898'061	371'700'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.12.2022		353'403'539	372'100'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.12.2022		352'442'077	370'150'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.12.2022		355'248'105	373'240'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.12.2022		355'683'238	375'140'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.12.2022		357'122'530	376'480'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.12.2022		356'386'578	374'970'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.12.2022		362'414'253	385'620'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.12.2022		359'151'378	382'470'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.12.2022		356'142'737	379'310'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.12.2022		357'068'674	379'050'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.12.2022		356'813'716	377'490'000		EUR/USD	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.12.2022		351'782'968	374'410'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 27.12.2022		374'410'000	352'761'054		USD/EUR	0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.12.2022		352'150'692	373'790'000		EUR/USD	0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 29.12.2022		373'790'000	352'642'056		USD/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/EUR	Verfall 03.01.2023		351'659'499	373'020'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 03.01.2023		373'020'000	351'266'091	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.01.2023		355'249'889	377'280'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 04.01.2023		377'280'000	353'675'685	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.01.2023		360'341'951	384'420'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.01.2023		367'754'075	388'240'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.01.2023		369'197'263	391'590'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.01.2023		365'199'007	384'170'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.01.2023		366'378'884	388'510'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.01.2023		373'158'537	400'890'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.01.2023		374'065'733	401'360'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.01.2023		381'059'860	409'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.01.2023		381'600'392	412'440'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 18.01.2023		412'440'000	380'816'960	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.01.2023		387'474'299	419'680'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.01.2023		390'154'543	421'490'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.01.2023		390'950'310	423'580'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.01.2023		389'226'413	419'950'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.01.2023		389'212'063	421'620'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.01.2023		386'972'491	420'440'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.01.2023		387'537'355	421'530'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.01.2023		390'092'269	425'420'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.01.2023		392'053'907	425'600'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.02.2023		389'875'632	422'640'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.02.2023		388'836'998	422'750'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.02.2023		387'350'789	420'680'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.02.2023		387'171'124	422'980'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.02.2023		386'227'434	422'550'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.02.2023		376'681'970	408'980'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.02.2023		376'730'455	404'280'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.02.2023		375'037'293	401'000'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.02.2023		375'850'976	403'190'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.02.2023		378'182'899	407'060'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.02.2023		373'819'520	399'100'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.02.2023		372'105'216	398'870'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.02.2023		375'249'065	402'270'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.02.2023		367'193'463	392'080'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.02.2023		367'874'131	392'690'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 22.02.2023		392'690'000	368'225'123	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.02.2023		369'533'440	394'110'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.02.2023		369'244'707	394'540'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.02.2023		370'531'703	393'840'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.02.2023		367'937'843	389'880'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.03.2023		367'808'328	387'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.03.2023		368'707'839	390'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.03.2023		371'433'838	393'960'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.03.2023		375'207'331	400'510'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.03.2023		374'219'159	397'060'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.03.2023		375'537'377	398'030'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.03.2023		376'693'731	402'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.03.2023		373'099'854	394'940'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.03.2023		369'748'154	390'220'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.03.2023		373'502'787	394'810'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.03.2023		378'890'291	405'000'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.03.2023		388'787'551	417'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.03.2023		388'248'383	416'330'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.03.2023		391'971'313	412'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.03.2023		390'756'324	415'060'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.03.2023		399'152'255	424'980'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.03.2023		401'026'393	430'020'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.03.2023		397'810'810	428'450'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.03.2023		396'752'521	428'190'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.03.2023		402'532'977	438'420'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.03.2023		405'306'147	436'200'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.03.2023		396'337'702	427'300'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.03.2023		386'515'170	418'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.04.2023		387'631'100	419'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.04.2023		387'612'454	423'060'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.04.2023		391'118'907	424'990'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.04.2023		390'789'356	425'570'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.04.2023		394'772'814	433'200'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.04.2023		401'088'789	437'710'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.04.2023		393'351'826	429'670'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.04.2023		394'289'929	430'330'000	EUR/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/EUR	Verfall 17.04.2023		395'335'822	434'090'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.04.2023		401'455'692	443'570'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.04.2023		395'738'812	435'600'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.04.2023		391'095'077	426'910'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.04.2023		390'229'710	427'850'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.04.2023		389'079'744	426'410'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.04.2023		392'002'572	430'420'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.04.2023		382'494'489	419'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.04.2023		384'107'203	423'710'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.04.2023		386'882'994	424'760'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.05.2023		390'115'316	430'960'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.05.2023		385'813'220	424'790'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.05.2023		383'847'707	423'760'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.05.2023		385'952'224	423'730'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.05.2023		389'652'851	430'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 09.05.2023		430'830'000	391'613'795	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.05.2023		396'477'232	436'210'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 10.05.2023		436'210'000	396'352'766	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.05.2023		386'731'999	425'650'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.05.2023		391'255'838	428'700'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.05.2023		393'111'460	431'430'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.05.2023		387'846'724	423'440'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.05.2023		390'205'288	423'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.05.2023		389'542'262	423'270'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 19.05.2023		423'270'000	389'550'508	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.05.2023		386'833'722	420'390'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 22.05.2023		420'390'000	388'544'863	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.05.2023		379'889'559	411'050'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.05.2023		377'807'155	407'530'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.05.2023		379'870'775	410'280'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.05.2023		379'663'980	409'210'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.05.2023		379'692'270	408'700'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.05.2023		374'992'485	402'300'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 31.05.2023		402'300'000	375'788'146	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.06.2023		375'763'576	402'300'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.06.2023		375'624'880	403'010'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.06.2023		378'038'454	403'130'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.06.2023		378'505'191	406'250'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.06.2023		377'288'474	404'650'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.06.2023		376'035'947	402'780'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.06.2023		374'660'729	400'520'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.06.2023		378'070'563	404'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.06.2023		376'968'065	406'070'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.06.2023		376'305'001	404'780'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.06.2023		374'897'822	402'910'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.06.2023		374'322'765	404'420'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.06.2023		373'850'368	405'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.06.2023		373'297'388	407'380'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 20.06.2023		407'380'000	372'840'094	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.06.2023		376'287'577	411'170'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.06.2023		370'274'056	403'660'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.06.2023		367'891'023	403'050'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.06.2023		368'416'971	403'820'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.06.2023		370'451'373	403'130'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.06.2023		368'442'402	401'920'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.06.2023		367'778'455	402'770'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.07.2023		366'576'770	399'620'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.07.2023		363'450'850	395'750'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.07.2023		366'752'861	400'180'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 06.07.2023		400'180'000	366'935'632	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.07.2023		359'279'845	391'850'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.07.2023		357'966'170	389'290'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.07.2023		354'735'457	385'510'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.07.2023		355'836'496	389'660'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.07.2023		357'129'193	392'040'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.07.2023		358'766'833	394'340'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.07.2023		361'487'701	402'090'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.07.2023		363'123'339	406'540'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.07.2023		361'777'215	406'770'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.07.2023		361'586'136	406'150'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.07.2023		366'215'519	411'540'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.07.2023		367'218'312	410'990'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.07.2023		367'447'593	409'610'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.07.2023		363'730'762	404'230'000	EUR/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/EUR	Verfall 27.07.2023		363'747'621	403'030'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.07.2023		363'013'100	400'930'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.07.2023		364'707'254	403'600'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.08.2023		361'156'421	396'990'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 02.08.2023		396'990'000	359'719'466	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.08.2023		362'174'788	399'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 03.08.2023		399'720'000	362'521'653	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.08.2023		366'058'428	403'640'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.08.2023		359'514'206	392'880'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.08.2023		357'455'815	390'790'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 09.08.2023		358'377'486	395'080'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 10.08.2023		356'343'269	392'100'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.08.2023		355'336'349	388'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.08.2023		354'984'502	389'970'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.08.2023		355'148'202	391'360'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 16.08.2023		353'544'776	387'910'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 17.08.2023		348'699'279	380'240'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.08.2023		349'187'836	382'030'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.08.2023		349'851'394	381'620'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.08.2023		347'186'701	378'070'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 23.08.2023		346'456'186	376'720'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 24.08.2023		345'845'201	376'540'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.08.2023		346'185'855	375'630'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.08.2023		350'473'083	380'230'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 29.08.2023		380'230'000	350'798'044	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 30.08.2023		350'624'058	380'060'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 30.08.2023		380'060'000	352'887'651	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 31.08.2023		352'396'772	379'550'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 01.09.2023		353'395'521	382'730'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 05.09.2023		356'425'046	389'610'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 06.09.2023		354'944'428	385'240'000	EUR/USD		0.00	0.00	
EUR/USD	Verfall 06.09.2023		385'240'000	356'472'657	USD/EUR		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 07.09.2023		355'798'226	384'530'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 08.09.2023		352'504'526	377'480'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 11.09.2023		351'600'800	376'530'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 12.09.2023		350'191'826	374'880'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 13.09.2023		353'069'846	378'350'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 14.09.2023		351'842'055	378'090'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 15.09.2023		348'951'768	373'850'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 18.09.2023		349'415'600	375'290'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 19.09.2023		347'512'358	370'640'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 20.09.2023		352'809'275	376'360'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 21.09.2023		351'039'231	374'750'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 22.09.2023		353'429'770	377'850'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 25.09.2023		355'067'888	380'680'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 26.09.2023		349'269'931	372'320'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 27.09.2023		352'089'255	375'290'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 28.09.2023		352'107'882	372'440'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 29.09.2023		348'480'647	368'830'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 02.10.2023		343'732'700	361'360'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 03.10.2023		340'624'380	359'800'000	EUR/USD		0.00	0.00	
USD/EUR	Verfall 04.10.2023		340'116'042	360'130'000	EUR/USD		35'789.26	0.00	b)
Klasse AAH EUR							35'789.26	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.10.2022		13'812'093	15'420'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.10.2022		13'828'377	15'600'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.10.2022		14'196'474	16'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.10.2022		14'096'031	15'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.10.2022		14'210'140	15'910'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 12.10.2022		15'910'000	14'291'361	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.10.2022		14'003'476	15'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.10.2022		13'747'788	15'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.10.2022		13'798'347	15'280'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.10.2022		13'607'803	15'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.10.2022		13'569'859	15'270'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.10.2022		13'671'969	15'630'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.10.2022		13'677'437	15'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.10.2022		13'473'701	15'170'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.10.2022		13'459'081	15'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.10.2022		13'648'203	15'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.10.2022		13'627'657	15'420'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.10.2022		13'758'254	15'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.10.2022		13'743'093	15'950'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.11.2022		13'755'930	15'930'000	GBP/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/GBP	Verfall 02.11.2022		13'588'223	15'750'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.11.2022		13'523'942	15'570'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.11.2022		13'618'618	15'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.11.2022		13'641'666	15'640'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.11.2022		13'498'005	15'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.11.2022		13'854'884	15'630'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.11.2022		13'860'516	15'890'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.11.2022		13'834'081	16'000'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.11.2022		14'218'289	16'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 15.11.2022		16'180'000	13'852'858	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.11.2022		14'383'303	16'800'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.11.2022		14'606'876	17'140'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.11.2022		14'649'139	17'430'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.11.2022		14'580'091	17'340'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.11.2022		14'543'559	17'130'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.11.2022		14'411'082	17'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.11.2022		14'407'865	16'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.11.2022		14'383'179	17'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 28.11.2022		17'090'000	14'163'179	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.11.2022		14'303'686	17'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.11.2022		14'443'591	17'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.12.2022		14'429'517	17'370'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.12.2022		14'459'147	17'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.12.2022		14'518'529	17'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.12.2022		16'008'699	19'640'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.12.2022		15'857'124	19'370'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.12.2022		15'804'771	19'310'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.12.2022		15'717'141	19'210'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.12.2022		15'865'285	19'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.12.2022		15'941'308	19'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.12.2022		15'958'563	19'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.12.2022		15'907'159	19'490'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.12.2022		16'228'594	20'120'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.12.2022		16'056'669	19'920'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.12.2022		15'969'080	19'510'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.12.2022		16'024'256	19'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.12.2022		15'993'616	19'400'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.12.2022		16'158'841	19'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 28.12.2022		19'620'000	16'202'824	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.12.2022		16'161'012	19'570'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 29.12.2022		19'570'000	16'270'369	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.01.2023		16'009'017	19'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 03.01.2023		19'260'000	16'005'318	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.01.2023		14'168'343	17'050'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 04.01.2023		17'050'000	14'146'443	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.01.2023		14'129'427	17'030'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.01.2023		14'414'994	17'310'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.01.2023		14'470'819	17'430'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.01.2023		14'315'374	17'010'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.01.2023		14'326'208	17'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.01.2023		14'631'520	17'840'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.01.2023		14'671'062	17'820'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.01.2023		14'613'993	17'720'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.01.2023		14'633'725	17'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 18.01.2023		17'790'000	14'562'868	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.01.2023		14'840'767	18'130'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.01.2023		14'909'398	18'310'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.01.2023		14'966'950	18'550'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.01.2023		14'944'768	18'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.01.2023		14'979'984	18'530'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.01.2023		14'857'514	18'380'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.01.2023		14'910'046	18'360'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.01.2023		15'022'443	18'570'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.01.2023		15'068'565	18'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.02.2023		15'003'800	18'540'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.02.2023		14'974'141	18'540'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.02.2023		14'963'055	18'420'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.02.2023		14'982'938	18'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.02.2023		14'933'798	18'360'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.02.2023		14'554'466	17'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.02.2023		13'603'347	16'340'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.02.2023		13'497'929	16'210'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.02.2023		13'535'104	16'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.02.2023		13'621'712	16'580'000	GBP/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/GBP	Verfall 15.02.2023		13'489'287	16'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.02.2023		13'415'458	16'280'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.02.2023		13'529'335	16'450'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.02.2023		13'239'471	15'890'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.02.2023		13'196'506	15'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 22.02.2023		15'850'000	13'208'884	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.02.2023		13'291'944	15'950'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.02.2023		13'252'904	16'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.02.2023		13'327'057	16'080'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.02.2023		13'232'706	15'910'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.03.2023		13'124'794	15'670'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.03.2023		13'153'497	15'820'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.03.2023		13'239'509	16'030'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.03.2023		13'318'147	15'990'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.03.2023		13'284'512	15'880'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.03.2023		13'324'128	15'960'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.03.2023		13'373'501	16'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.03.2023		13'282'399	15'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.03.2023		13'111'054	15'520'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.03.2023		13'255'819	15'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.03.2023		13'460'251	16'290'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.03.2023		13'808'963	16'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.03.2023		13'807'287	16'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.03.2023		13'938'105	16'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.03.2023		13'877'933	16'810'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.03.2023		14'191'863	17'230'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.03.2023		14'220'132	17'430'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.03.2023		14'137'214	17'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.03.2023		14'094'467	17'240'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.03.2023		14'274'365	17'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.03.2023		14'400'432	17'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.03.2023		14'064'216	17'260'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.03.2023		14'153'868	17'450'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.04.2023		14'205'249	17'490'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.04.2023		14'197'743	17'580'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.04.2023		14'321'764	17'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.04.2023		14'324'568	17'760'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.04.2023		14'498'762	18'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.04.2023		14'695'496	18'300'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.04.2023		14'427'195	17'940'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.04.2023		14'435'283	17'950'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.04.2023		14'484'629	18'060'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.04.2023		14'770'051	18'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.04.2023		14'562'042	18'120'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.04.2023		14'389'932	17'790'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.04.2023		14'402'034	17'900'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.04.2023		14'353'615	17'870'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.04.2023		14'466'018	18'020'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.04.2023		13'397'571	16'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.04.2023		13'438'423	16'750'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.04.2023		13'521'189	16'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.05.2023		13'647'608	17'020'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.05.2023		13'498'805	16'830'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.05.2023		13'428'489	16'880'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.05.2023		13'561'378	16'900'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.05.2023		13'681'740	17'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.05.2023		13'902'885	17'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.05.2023		13'578'082	17'130'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.05.2023		13'791'081	17'400'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.05.2023		13'876'044	17'510'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.05.2023		13'680'153	17'130'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.05.2023		13'775'077	17'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.05.2023		13'739'354	17'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 19.05.2023		17'190'000	13'757'503	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.05.2023		13'652'565	17'060'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 22.05.2023		17'060'000	13'685'773	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.05.2023		13'388'621	16'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.05.2023		13'315'344	16'560'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.05.2023		13'396'899	16'640'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.05.2023		13'371'658	16'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.05.2023		13'383'947	16'550'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.05.2023		13'231'942	16'320'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.06.2023		13'256'212	16'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.06.2023		13'270'181	16'470'000	GBP/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/GBP	Verfall 05.06.2023		13'310'960	16'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.06.2023		13'393'205	16'770'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.06.2023		13'371'480	16'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.06.2023		13'321'218	16'530'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.06.2023		13'275'005	16'470'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.06.2023		13'391'908	16'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.06.2023		13'337'843	16'720'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.06.2023		13'304'964	16'740'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.06.2023		13'278'148	16'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.06.2023		13'239'396	16'690'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.06.2023		13'238'785	16'810'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.06.2023		13'211'185	16'840'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 20.06.2023		16'840'000	13'143'415	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.06.2023		13'322'636	17'070'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.06.2023		13'089'714	16'670'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.06.2023		13'046'381	16'610'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.06.2023		13'040'787	16'620'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.06.2023		13'115'028	16'670'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.06.2023		13'053'664	16'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.06.2023		13'016'808	16'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.07.2023		12'973'069	16'360'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.07.2023		12'879'244	16'250'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.07.2023		12'977'207	16'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 06.07.2023		16'500'000	13'002'262	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.07.2023		13'727'128	17'420'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.07.2023		13'674'458	17'390'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.07.2023		13'588'032	17'250'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.07.2023		13'614'884	17'460'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.07.2023		13'637'913	17'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.07.2023		13'731'109	17'710'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.07.2023		13'848'391	18'000'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.07.2023		13'879'557	18'200'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 19.07.2023		13'843'674	18'160'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 20.07.2023		13'829'334	18'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.07.2023		14'010'232	18'330'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.07.2023		14'038'328	18'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.07.2023		14'032'358	18'040'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 26.07.2023		13'912'028	17'870'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 27.07.2023		13'910'680	17'830'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 28.07.2023		13'883'185	17'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.07.2023		13'951'167	18'030'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 02.08.2023		13'792'245	17'720'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 02.08.2023		17'720'000	13'774'233	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 03.08.2023		13'875'048	17'850'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 03.08.2023		17'850'000	13'872'590	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 04.08.2023		13'973'530	17'980'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.08.2023		13'795'148	17'500'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.08.2023		13'714'579	17'410'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 09.08.2023		13'780'453	17'580'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 10.08.2023		13'687'260	17'480'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.08.2023		13'639'401	17'350'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.08.2023		13'649'754	17'380'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 15.08.2023		13'662'929	17'400'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 16.08.2023		13'584'536	17'270'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 17.08.2023		13'474'460	17'060'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 18.08.2023		13'486'378	17'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 21.08.2023		13'510'186	17'230'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 22.08.2023		13'451'966	17'160'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 23.08.2023		13'450'665	17'120'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 24.08.2023		13'418'711	17'080'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 25.08.2023		13'421'601	17'090'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 29.08.2023		13'584'096	17'230'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 30.08.2023		13'583'170	17'180'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 31.08.2023		13'694'810	17'190'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 01.09.2023		13'724'972	17'280'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 05.09.2023		13'819'545	17'590'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 06.09.2023		13'763'734	17'440'000	GBP/USD		0.00	0.00	
GBP/USD	Verfall 06.09.2023		17'440'000	13'820'539	USD/GBP		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 07.09.2023		13'804'602	17'420'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 08.09.2023		13'661'001	17'150'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 11.09.2023		13'643'351	17'040'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 12.09.2023		13'577'548	16'940'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 13.09.2023		13'695'141	17'100'000	GBP/USD		0.00	0.00	
USD/GBP	Verfall 14.09.2023		13'656'121	17'110'000	GBP/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/GBP Verfall 15.09.2023		13'541'396	16'880'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 18.09.2023		13'559'810	16'940'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 19.09.2023		13'489'603	16'750'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 20.09.2023		13'697'227	16'980'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 21.09.2023		13'635'473	16'880'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 22.09.2023		13'714'833	17'010'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 25.09.2023		13'782'625	17'090'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 26.09.2023		13'559'609	16'660'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 27.09.2023		13'679'885	16'780'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 28.09.2023		13'657'994	16'660'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 29.09.2023		13'534'958	16'470'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 02.10.2023		13'383'086	16'240'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 03.10.2023		13'273'745	16'190'000		GBP/USD	0.00	0.00		
	USD/GBP Verfall 04.10.2023		13'256'862	16'180'000		GBP/USD	791.51	0.00	b)	
Klasse AAH GBP								791.51	0.00	
Devisentermingeschäfte auf Klassen								423'041.13	0.01	

	Kurswert CHF	in % 7)
Vermögensaufstellung		
Bankguthaben auf Sicht	842'522.48	0.01
Andere Anlagen - Edelmetalle	8'238'373'331.29	99.98
Derivative Finanzinstrumente	423'041.13	0.01
Sonstige Vermögenswerte	567.16	0.00
Gesamtfondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	8'239'639'462.06	100.00
Andere Verbindlichkeiten	-8'295'658.77	
Nettofondsvermögen am Ende der Rechnungsperiode	8'231'343'803.29	

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);	8'238'373'331.29	99.98
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern;	423'041.13	0.01
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

EUR	1 = CHF	0.96854454
GBP	1 = CHF	1.11655914
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	1'502'247'968.00	18.25

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)		Rücknahmespesen, Rücknahmekomm. in % zu Gunsten 30)	
		Teilvermögen	Fondsleitung	Teilvermögen	Fondsleitung
AA CHF	CHF	-	-	-	-
AA EUR	CHF	-	-	-	-
AA GBP	CHF	-	-	-	-
AA USD	CHF	-	-	-	-
AAH CHF	CHF	-	-	-	-
AAH EUR	CHF	-	-	-	-
AAH GBP	CHF	-	-	-	-

6 Zusätzliche Informationen und Ausserbilanzgeschäfte

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

Am Bilanzstichtag in Pension gegebene Effekten	Währung	Betrag
Keine	CHF	-

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

7 Pauschale Verwaltungskommission

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

Im Geschäftsjahr effektiv belastete Sätze:

Periode: 01.10.2022 - 30.09.2023

Klasse	PVK p.a. in %		PMF p.a. in %	PAF p.a. in %	VK Zielfonds p.a. in %
	Eff	Max	Eff	Eff	Max
AA CHF	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AA EUR	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AA GBP	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AA USD	0.400	1.000	0.300	0.100	-
AAH CHF	0.400	1.050	0.300	0.100	-
AAH EUR	0.400	1.050	0.300	0.100	-
AAH GBP	0.400	1.050	0.300	0.100	-

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

Dieser Fonds 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 Ausschüttung des Nettoertrags 2022 / 2023

Ex-Datum: 23.01.2024

Ausschüttung an Anteilscheininhaber

Zahlbar: 26.01.2024

Klasse	Affidavit-fähig	Währung	Brutto je Anteil	Abzgl. 35% Eidg. Vst	Netto je Anteil
AA CHF	Nein	CHF	-	-	-
AA EUR	Nein	CHF	-	-	-
AA GBP	Nein	CHF	-	-	-
AA USD	Nein	CHF	-	-	-
AAH CHF	Nein	CHF	-	-	-
AAH EUR	Nein	CHF	-	-	-
AAH GBP	Nein	CHF	-	-	-

11 Fussnoten

- 1) Der Nettoinventarwert wird mathematisch auf 0.01 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.
- 35) Devisentermingeschäfte, welche ausschliesslich zum Zweck der Währungsabsicherung abgeschlossen werden, sind im Zeitpunkt der Eröffnung zum Einstandskurs bewertet. An den darauffolgenden Bankwerktagen, werden diese Devisentermingeschäfte zum Wiederbeschaffungswert bewertet.

12 Grundsätze für die Bewertung sowie Berechnung der Nettoinventarwerte

1. Der Nettoinventarwert des Anlagefonds und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des Anlagefonds berechnet. Für Tage, an welchen der Goldhandel in London geschlossen ist (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Fondsvermögens statt.
2. Der Wert des Goldes wird aufgrund der Nachmittags-Schlusskurse des Goldhandels in London (LBMA Gold Price PM in USD) berechnet. Die als Bankguthaben gehaltenen flüssigen Mittel werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit der neuen Markttrendite angepasst.
3. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Fondsvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten des Anlagefonds, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf 1/100 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet.
4. Die Quoten am Verkehrswert des Nettofondsvermögens (Fondsvermögen abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstaussgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstaussgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Anlagefonds für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettofondsvermögen, getätigt wurden.

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **Swisscanto ETF Precious Metal**

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

mit dem Teilvermögen

Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold

(nachfolgend "das Teilvermögen")

und des **ZKB Gold ETF**

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend der "Anlagefonds")

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und die Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigen, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, ein Teilvermögen des Umbrella-Fonds mit dem Anlagefonds zu vereinigen und die Fondsverträge des Umbrella-Fonds bzw. Teilvermögen und des Anlagefonds gemäss den nachfolgenden Ausführungen zu ändern.

In Teil I und II dieser Veröffentlichung finden sich die Ausführungen zu der Vereinigung und zu den in Zusammenhang mit der Vereinigung erforderlichen Fondsvertragsänderungen.

In Teil III dieser Veröffentlichung wird die zusätzliche Fondsvertragsänderung beim Anlagefonds ZKB Gold ETF, welche keinen Zusammenhang mit der geplanten Vereinigung aufweist, erläutert.

Im Übrigen wurden einzelne Anpassungen des Fondsvertrages formeller Natur vorgenommen.

Teil I – Allgemeine Angaben, Ablauf und Voraussetzungen der Vereinigung

1 Geplante Vereinigung

Die Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, mit Zustimmung der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, beabsichtigt, unter Vorbehalt der Genehmigung der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA, die folgende Vereinigung des übertragenden Teilvermögens des Umbrella-Fonds Swisscanto ETF Precious Metal mit dem übernehmenden Anlagefonds ZKB Gold ETF durchzuführen:

Übertragendes Teilvermögen des Umbrella-Fonds Swisscanto ETF Precious Metal	Übernehmender Anlagefonds	Stichtag der Vereinigung (Wirkung per – Datum)
Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold	ZKB Gold ETF	23. Oktober 2023

2 Gründe für die Vereinigung

Mit der Vereinigung soll eine Konsolidierung der Produktpalette erreicht werden, welche die Produkttransparenz erhöht und im Interesse der Anleger ist. Die Vereinigung erlaubt das Eliminieren von Doppelspurigkeiten und ermöglicht ein kosteneffizienteres Fondsmanagement.

3 Voraussetzungen für die Vereinigung

Die Voraussetzungen für die Vereinigung sind in Art. 114 Abs. 1 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) sowie in § 25 der Fondsverträge des übertragenden Teilvermögens sowie des übernehmenden Anlagefonds geregelt. Sämtliche Voraussetzungen für die geplante Vereinigung sind erfüllt:

- Die Möglichkeit der Vereinigung ist bei dem übertragenden Teilvermögen sowie übernehmenden Anlagefonds in § 25 des Fondsvertrages vorgesehen.
- Die zu vereinigenden Teilvermögen werden von der gleichen Fondsleitung, der Swisscanto Fondsleitung AG, verwaltet.
- Nach Vollzug der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen stimmen die Fondsverträge der zu vereinigenden Teilvermögen hinsichtlich folgender Bestimmungen grundsätzlich überein:
 - a) Die Anlagepolitik, die Anlagetechniken und die Risikoverteilungsvorschriften sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - b) Die Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - c) Die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (Courtage, Gebühren, Abgaben), die dem Vermögen der Teilvermögen oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - d) Die Rücknahmebedingungen;
 - e) Die Laufzeit des Fondsvertrages und die Voraussetzungen der Auflösung.
- Die Vermögen der zu vereinigenden Teilvermögen werden auf den gleichen Tag bewertet, das Umtauschverhältnis berechnet und die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten übernommen.
- Weder den zu vereinigenden Teilvermögen noch den Anlegern erwachsen aus den Vereinigungen Kosten.

4 Vereinigungsverfahren

Nach Inkrafttreten der in Teil II dieser Mitteilung erläuterten Änderungen des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird mit Wirkung per dem oben unter Ziff. 1 erwähnten Datum das übertragende Teilvermögen mit dem übernehmenden Anlagefonds vereinigt. Die Vereinigung erfolgt durch Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf den übernehmenden Anlagefonds. Auf den Zeitpunkt der Vereinigung wird das übertragende Teilvermögen ohne Liquidation aufgelöst.

Die Anleger der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens erhalten nach der Berechnung des Umtauschverhältnisses Anteile der nachfolgend aufgeführten Anteilsklassen des übernehmenden Anlagefonds. Die Anteilsklassen des übertragenden Teilvermögens entsprechen dabei jeweils vollumfänglich der Anteilsklasse des übernehmenden Anlagefonds, in welche sie im Rahmen der Vereinigung überführt werden.

Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold (übertragendes Teilvermögen)	ZKB Gold ETF (übernehmender Anlagefonds)
Anteilsklasse A	Anteilsklasse AA USD
Anteilsklasse A (CHF)	Anteilsklasse AAH CHF
Anteilsklasse A (EUR)	Anteilsklasse AAH EUR
Anteilsklasse A (GBP)	Anteilsklasse AAH GBP
Anteilsklasse AX	Anteilsklasse AA USD
Anteilsklasse AX (CHF)	Anteilsklasse AAH CHF

Anteilsklasse AX (EUR)	Anteilsklasse AAH EUR
Anteilsklasse AX (GBP)	Anteilsklasse AAH GBP

Am 24. Oktober 2023 wird die Bewertung der Anlagen des übernehmenden Anlagefonds bzw. übertragenden Teilvermögens aufgrund der Schlusskurse vom 23. Oktober 2023 durchgeführt. Am 24. Oktober 2023 (Bewertungstag), erfolgt die Vereinigung durch die Übertragung sämtlicher Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des übertragenden Teilvermögens auf den übernehmenden Anlagefonds rückwirkend auf 23. Oktober 2023 (Vereinigungstichtag).

5 Stellungnahme der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

Die kollektivanlagengesetzliche Prüfgesellschaft Ernst & Young AG, Zürich, hat mit Schreiben vom 28. Juni 2023 zuhanden der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA bestätigt, dass nach ihrer Auffassung die gesetzlichen und fondsvertraglichen Voraussetzungen für die geplante Vereinigung erfüllt sind.

6 Vollzug der Vereinigung

Die Prüfgesellschaft wird den Vollzug der Vereinigung überwachen und prüfen. Nach erfolgter Durchführung und abgeschlossener Prüfung der Vereinigung durch die Prüfgesellschaft wird die Fondsleitung den Vollzug der Vereinigung mit Bekanntgabe der Umtauschverhältnisse sowie der Bericht der Prüfgesellschaft betreffend die ordnungsgemässe Durchführung der Vereinigung auf www.fundinfo.com veröffentlichen.

7 Kosten

Dem übertragenden Teilvermögen und den Anlegerinnen und Anlegern erwachsen aus der Vereinigung keine Kosten. Sämtliche Kosten werden von der Fondsleitung getragen.

8 Aufschub der Rückzahlung bzw. Einstellung der Ausgabe von Anteilen

Aus technischen Gründen werden die Ausgaben bzw. Rückzahlungen von Anteilen des übertragenden Teilvermögens und des übernehmenden Anlagefonds an den folgenden Daten aufgeschoben bzw. eingestellt:

Übertragendes Teilvermögen	Letzter Cut Off (bis 15.00 Uhr)	Übernehmender Anlagefonds	Letzter Cut Off (bis 15.00 Uhr)	Geschlossen
Swisscanto ETF Precious Metal Physical Gold	19. Oktober 2023	ZKB Gold ETF	19. Oktober 2023	20. Oktober 2023 bis 25. Oktober 2023

9 Steuerfolgen aufgrund der Vereinigung

Der Umtausch der Anteile anlässlich der Vereinigung führt zu keinen Emissions- oder Umsatzabgabefolgen. Die Vereinigung löst auf Ebene des an der Vereinigung beteiligten Teilvermögens und des Anlagefonds weder Ertrags- noch Gewinnsteuern aus.

Teil II – Änderungen im Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens

Im Hinblick auf die Vereinigung muss der Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens angepasst werden.

1 Übersicht über die fondsvertraglichen Änderungen

Um die gemäss § 25 Ziff. 2 Bst. c des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens sowie des übernehmenden Anlagefonds massgeblichen Fondsvertragsbestimmungen des übertragenden Teilvermögens für die Vereinigung mit dem übernehmenden Anlagefonds in Einklang mit den betreffenden Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds zu bringen, sollen folgende Bestimmungen des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens angepasst werden:

- Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken (vgl. Ziff. 2.1, 2.2 und 2.3 nachstehend)
- Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten (vgl. Ziff. 3 nachstehend)
- Art, die Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen (vgl. Ziff. 4.1, 4.2 und 4.3 nachstehend)
- Rücknahmebedingungen (vgl. Ziff. 5 nachstehend)
- Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung (vgl. Ziff. 6 nachstehend)

2 Anlagepolitik, Anlagetechniken, Risikoverteilungsvorschriften und Risiken

2.1 Anlagepolitik

Infolge der Vereinigung und im Sinne einer Angleichung des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens an die entsprechenden Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds, werden sowohl die Bestimmungen des Allgemeinen Teils sowie die des Besonderen Teils der Anlagepolitik des übertragenden Teilvermögens, angepasst.

Die Bestimmungen in § 8 Ziff. 1, 2, 3 und 4 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens lauten neu wie folgt:

- "1. Das Anlageziel des Anlagefonds besteht darin, langfristig die Wertentwicklung des Goldes, nach Abzug der dem Anlagefonds belasteten Vergütungen und Nebenkosten, zu reflektieren.*
- 2. Zu diesem Zweck investiert der Anlagefonds ausschliesslich in physisches Gold in kuranter Form. Das Gold wird dabei in Barren der Standardeinheit à ca. 12.5 kg mit der Feinheit 995/1000 oder besser gehalten. Der Prospekt enthält weitere Informationen.*
- 3. Der Anlagefonds wird nicht aktiv verwaltet. Es werden anlageseitig keine Handlungen vorgenommen, um den Wert der Anteile des Anlagefonds zu erhöhen oder allfällige Verluste auszugleichen, welche durch Veränderungen des Wertes der Anlagen des Anlagefonds entstanden sind.*
- 4. Der Anlagefonds tätigt keine Leerverkäufe (Short Sales). Das Fondsvermögen wird nicht durch Kreditaufnahme für Anlagezwecke mit einer Hebelwirkung (Leverage) versehen (vgl. § 14 unten)."*

Bis anhin erfolgten nicht ausschliesslich Investitionen in physisches Gold. Daneben konnten unter anderem 10% des Vermögens des Teilvermögens direkt in Forderungswertpapiere und -wertrechte sowie Geldmarktinstrumente investiert werden.

Die Ziffer 5 von § 8 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens erfährt keine materielle Änderung. Die Bestimmungen im Besonderen Teil in § 31A werden vollumfänglich gestrichen.

2.2 Anlagetechniken und -instrumente

Die bisher beim übertragenden Teilvermögen zur Anwendung kommenden Bestimmungen betreffend Leerverkäufe und Hebelwirkung (vgl. § 10 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens) werden, in Übereinstimmung mit den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds, ersatzlos gestrichen. Entsprechend wird der Absatz § 13 Ziff. 2 betreffend die Thematik der Leerverkäufe beim übertragenden Teilvermögen ebenfalls ersatzlos gestrichen.

Die zu beurteilenden Vorschriften innerhalb der Edelmetalleihe des zu vereinigenden Teilvermögen und des Anlagefonds stimmen grundsätzlich überein (vgl. § 11 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

In Übereinstimmung mit den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds setzt die Fondsleitung neu bei den nicht währungsbesicherten Anteilsklassen AA, AA CHF, AA USD, AA EUR und AA GBP keine Derivate ein (vgl. § 13 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). Bei den währungsbesicherten Anteilsklassen AAH CHF, AAH USD, AAH EUR und AAH GBP setzt die Fondsleitung wie bisher Derivate zur Absicherung von Währungsrisiken ein. Derivate dürfen bei den währungsbesicherten Anteilsklassen nur engagementreduzierend, zur Absicherung der Anlagen in Gold (ausgedrückt in US-Dollars) und allfälliger Guthaben und Forderungen, die nicht auf die Referenzwährung der entsprechenden, währungsbesicherten Anteilsklassen lauten, gegen die Referenzwährung derselben verwendet werden (vgl. § 13 Ziff. 4 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens). Die Bestimmung, wonach die Fondsleitung standardisierte sowohl als auch nicht standardisierte Derivate einsetzen kann, kommt findet keine Anwendung mehr (vgl. § 13 Ziff. 8 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

In § 14 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens betreffend die Aufnahme und Gewährung von Krediten wird neu festgehalten, dass die Fondsleitung für höchstens 5% (bisher 10%) seines Nettovermögens vorübergehend Kredite aufnehmen darf. Zudem war bis anhin im Fondsvertrag des übertragenden Teilvermögens erwähnt, dass durch die Kreditaufnahme u.a. ausstehende Forderungen auf Erstattung von Mehrwertsteuer aus Vorsteuerabzug bei Anlagen in Silber, Platin und Palladium ausgeglichen wurden, die Kosten der Kreditaufnahme zulasten der Fondsleitung gingen und diese von der Verwaltungskommission in Abzug zu bringen sind. In Angleichung an die Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds wurden diese Spezifizierungen gestrichen.

Sodann wird, in Angleichung an die Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds, in § 15 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens die Limite bis zu welchem Höchstprozentsatz des Nettovermögens des Fondsvermögens die Fondsleitung den Anlagefonds zur Absicherung von Verpflichtungen aus Derivaten zur Währungsabsicherung verpfänden oder zur Sicherung übereignen darf, von 25% auf 30% erhöht.

2.3 Risikoverteilung und Risiken

Die Bestimmung, wonach die Fondsleitung einschliesslich Derivate höchstens 10% des Vermögens eines Teilvermögens in Effekten und Geldmarktinstrumente desselben Emittenten anlegen darf, wird ersatzlos gestrichen (vgl. § 16 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Im Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds werden Edelmetallkonten sowie Anlagen in Bankguthaben nicht mehr als flüssige Mittel berücksichtigt (vgl. § 16 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

In der neuen Ziff. 2 von § 16 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird in Einklang mit den Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds ergänzt, dass die Fondsleitung höchstens 10% des Fondsvermögens in Derivaten desselben Emittenten bzw. bei derselben Gegenpartei anlegen darf.

Zudem wird in § 16 Ziff. 3 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens präzisiert, dass die Fondsleitung Anlagen in OTC-Geschäften bei derselben Gegenpartei nur zu Währungsabsicherungszwecken tätigen darf.

Entsprechend den Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds wird in § 16 Ziff. 4 des angepassten Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens eine Ergänzung vorgenommen, dass nebst Guthaben und Forderungen auch Währungsabsicherungsinstrumente aus Derivaten zur Währungsabsicherung desselben Emittenten bzw. Schuldners nicht die Limite von 20% des Fondsvermögen übersteigen darf.

3 Verwendung des Nettoertrages und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten

In § 23 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens wird analog den Bestimmungen des übernehmenden Anlagefonds präzisiert, dass bis zu 30% des Nettoertrages des laufenden Geschäftsjahres und die vorgetragenen Erträge aus früheren Rechnungsjahren des Anlagefonds bzw. aller Anteilklassen auf neue Rechnung vorgetragen werden können. Zusätzlich wird eine Ergänzung vorgenommen, dass in jedem Fall mindestens 70% des jährlichen Nettoertrags inklusive der vorgetragenen Erträge früherer Rechnungsjahre ausgeschüttet werden. Die Bestimmung betreffend Verzicht auf Ausschüttung kommen beim übernehmenden Anlagefonds unter denselben Vorbehalten zur Anwendung, jedoch gelten diese neu auch für den Vortrag des gesamten Nettoertrags auf neue Rechnung des Anlagefonds bzw. der entsprechenden Anteilklasse.

4 Art, Höhe und Berechnung aller Vergütungen, Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen

4.1 Berechnung des Nettoinventarwertes

Die Bestimmungen in § 17 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens zur Berechnung des Nettoinventarwertes werden dahingehend angepasst, dass keine Berechnung des Fondsvermögens an Tagen, an welchen der Goldhandel in London (bisher: Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des jeweiligen Teilvermögens) geschlossen ist, stattfindet. Der Wert des Goldes wird aufgrund der Nachmittags-Schlusskurse des Goldhandels in London (LBMA Gold Price PM in USD) berechnet (vgl. Anpassung in Ziff. 2 von § 17 des Fondsvertrages). Der Nettoinventarwert wird neu auf 1/100 der Referenzwährung der entsprechenden Anteilklasse gerundet.

Die bereits bestehenden Ziff. 3 betreffend die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben und Ziff. 5 betreffend die Quoten am Verkehrswert von § 17 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens erfahren keine materiellen Änderungen.

4.2 Vergütung und Nebenkosten zulasten der Anleger

Analog zu den Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds werden die Ausgabe- und Rücknahmekommission zu Gunsten der Fondsleitung, der Depotbank und/oder von Vertreibern bzw. die Kommission für die Sachauslage neu in § 19 Ziff. 1 sowie Ziff. 3 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens aufgeführt und nicht mehr im Besonderen Teil des Fondsvertrages.

4.3 Vergütungen und Nebenkosten zulasten des Vermögens der Teilvermögen

Der Inhalt in § 20 wird dahingehend an die Bestimmungen des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds angepasst, indem die pauschale Verwaltungskommission nicht mehr im Besonderen Teil des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens ausgewiesen wird, sondern in § 20 Ziff. 1. Die pauschale Verwaltungskommission wird von bisher 0.50% auf die folgenden Maximalsätze pro Anteilklasse angehoben:

AA Klasse:	max. 1.00% p.a.
AA CHF Klasse:	max. 1.00% p.a.
AA USD Klasse:	max. 1.00% p.a.
AA EUR Klasse:	max. 1.00% p.a.

AA GBP Klasse: max. 1.00% p.a.
AAH CHF Klasse: max. 1.05% p.a.
AAH USD Klasse: max. 1.05% p.a.
AAH EUR Klasse: max. 1.05% p.a.
AAH GBP Klasse: max. 1.05% p.a.

Zudem wird die Kommission von maximal 0.25% des Bruttoertrages der Ausschüttung für die Auszahlung des Jahresertrages an die Anteilinhaber nicht mehr im Fondsvertrag erwähnt.

Abschliessend wird in § 20 Ziff. 2 des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens neu ausgeführt, dass Kosten für den An- und Verkauf von Anlagen, namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben, sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen sowie alle Kosten, die durch die Ergreifung ausserordentlicher Schritte zur Wahrung der Anlegerinteressen durch die Fondsleitung, den Vermögensverwalter kollektiver Kapitalanlagen oder die Depotbank verursacht werden, nicht in der pauschalen Verwaltungskommission enthalten sind.

5 Rücknahmebedingungen

In § 18 Ziff. 7 Bst. a des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens betreffend die Berechtigung zur Auszahlung von Sachauslagen wird der Verweis auf die Bestimmungen im Besonderen Teil des Fondsvertrages entfernt. Das Recht zur Auszahlung des Gegenwerts seiner Anteile in Gold (Sachauslage) anstelle in bar ist jeder Anlegerin und jedem Anleger gewährt. Die Möglichkeit eines Antrages zur Auslieferung von anderen handelsüblichen Einheiten entfällt. Das Recht auf Sachauslage ist auf Standardeinheiten beschränkt. Zusätzlich entfällt die Bestimmung, wonach eine Forderung einer physischen Lieferung, welche nicht auf schriftlichem Wege erfolgt ist, in bar ausbezahlt wird (vgl. § 18 Ziff. 7 Bst. c des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens).

Zudem wird die Bestimmung in § 18 Ziff. 7 Bst. d des bisherigen Fondsvertrages ersatzlos gestrichen, wonach der Ort der Auslieferung des physischen Goldes in der Schweiz liegen muss. Es gelten die Bestimmungen des Prospekts.

6 Laufzeit des Fondsvertrages und Voraussetzungen der Auflösung

Die Laufzeit des Fondsvertrages des übertragenden Teilvermögens und des übernehmenden Anlagefonds sowie die Voraussetzungen der Auflösung bei dem zu vereinigenden Teilvermögen und dem übernehmenden Anlagefonds stimmen grundsätzlich überein.

Teil III – Änderung im Fondsvertrag des übernehmenden Anlagefonds

Die zusätzliche Änderung im Fondsvertrag des ZKB Gold ETF betrifft die Belastung der Pauschalkommission (PVK) zu Lasten des Fondsvermögens. Neu wird die Pauschalkommission monatlich, und nicht wie bisher jeweils am Quartalsende, in Rechnung gestellt (vgl. § 19 Ziff. 1 des Fondsvertrages des übernehmenden Anlagefonds).

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} 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 Teil II Ziff. 2 sowie Teil III der vorliegenden Publikation beschriebenen Änderungen der Fondsverträge 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 Teilvermögens bzw. des Anlagefonds in bar verlangen können bzw. den Antrag auf Sachauslage stellen können.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Umbrella-Fonds Swisscanto ETF Precious Metal und des Anlagefonds ZKB Gold ETF, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformationsblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 23. August 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich

Mitteilung an die Anlegerinnen und Anleger

des **ZKB Gold ETF**

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts
der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen"
(nachfolgend der "Anlagefonds")

Mit Veröffentlichung vom 23. August 2023 wurde, unter Vorbehalt der Genehmigung durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, von der Swisscanto Fondsleitung AG, als Fondsleitung, und der Zürcher Kantonalbank, als Depotbank, eine Anpassung des Fondsvertrages beantragt.

Die beantragte Änderung des Fondsvertrages unter Teil III der Veröffentlichung, wonach die Pauschalkommission dem Fondsvermögens künftig jeweils monatlich in Rechnung gestellt werden soll, wird zurückgezogen.

Der Prospekt mit integriertem Fondsvertrag des Anlagefonds, die Jahres- und Halbjahresberichte, das Basisinformativblatt der Anteilsklassen sowie die Änderungen im Wortlaut können kostenlos bei der Fondsleitung und der Depotbank bezogen werden.

Zürich, 05. Oktober 2023

Die Fondsleitung:

Swisscanto Fondsleitung AG
Zürich

Die Depotbank:

Zürcher Kantonalbank
Zürich