

Swisscanto (LU)

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30.09.2024

Investmentfonds gemäss Teil I des Luxemburger Gesetzes in der Rechtsform eines Fonds Commun de Placement (FCP)

Verwaltungsgesellschaft: SWISSCANTO ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL S.A.
R.C.S. B-121.904

Depotbank: CACEIS Investor Services Bank S.A.

Auf der Grundlage der Jahres- und Halbjahresberichte dürfen keine Zeichnungen entgegengenommen werden.
Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht und gegebenenfalls der letzte Halbjahresbericht beigefügt wird.

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

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|----|---|----|
| 1 | Verwaltung und Organe | 3 |
| 2 | Allgemeine Informationen | 4 |
| 3 | Aktivitätsbericht | 5 |
| 4 | Vermögensaufstellung | 6 |
| 5 | Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens | 8 |
| 6 | Statistik | 9 |
| 7 | Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | 10 |
| 8 | Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection | 13 |
| 9 | Erläuterungen | 19 |
| 10 | Ungeprüfte Informationen | 26 |

1 Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

Swisscanto Asset Management International S.A.
6, route de Trèves, L-2633 Senningerberg, Luxemburg

Verwaltungsrat

Präsident

Hans Frey, Schweiz, Geschäftsführer Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Mitglieder

Richard Goddard, Luxemburg, Independent Company Director, The Directors' Office, Luxemburg
Roland Franz, Luxemburg, Geschäftsführer Swisscanto Asset Management International S.A., Luxemburg
Anne-Marie Arens, Luxemburg, Independent Company Director, Luxemburg
Steve Michel, Schweiz, Leiter Sales Asset Management Zürcher Kantonalbank, Schweiz (ab 29.09.2023)

Geschäftsführung

Roland Franz, Luxemburg
Jasna Ofak, Luxemburg
Michael Weiß, Deutschland

Depotbank, Hauptzahl-, Register- und Transferstelle

CACEIS Investor Services Bank S.A.
14, Porte de France, L-4360 Esch-sur-Alzette, Luxemburg

Zentralverwaltungsstelle

Swisscanto Fondsleitung AG
Bahnhofstrasse 9, CH-8001 Zürich, Schweiz

Portfolio Manager

Zürcher Kantonalbank,
Bahnhofstrasse 9, CH-8001 Zürich, Schweiz

Zahl- und Vertriebsstellen

Deutschland

DekaBank
Deutsche Girozentrale
Mainzer Landstrasse 16, D-60325 Frankfurt am Main
(die „deutsche Zahl- und Informationsstelle“)

Liechtenstein

Bendura Bank AG
Schaaner Strasse 27, FL-9487 Gamprin-Bendern

Luxemburg

CACEIS Investor Services Bank S.A.
14, Porte de France, L-4360 Esch-sur-Alzette

Österreich

Vorarlberger Landes- und Hypothekenbank Aktiengesellschaft
Hypo-Passage 1, A-6900 Bregenz

Zahlstelle in der Schweiz

Zürcher Kantonalbank,
Bahnhofstrasse 9, CH-8001 Zürich, Schweiz

Vertreterstelle in der Schweiz

Swisscanto Fondsleitung AG,
Bahnhofstrasse 9, CH-8001 Zürich, Schweiz

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

Ernst & Young S.A.
35E, Avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxemburg, Luxemburg

2 Allgemeine Informationen

Anlagefonds nach luxemburgischem Recht „Umbrella Construction“

Swisscanto (LU) ist den gesetzlichen Bestimmungen des ersten Teils des luxemburgischen Gesetzes betreffend die Organismen für gemeinsame Anlagen vom 17. Dezember 2010 unterstellt.

Die Vertragsbedingungen des Anlagefonds wurden am 5. Dezember 2006 von der Verwaltungsgesellschaft festgesetzt.

Die Satzung der Verwaltungsgesellschaft sowie die Vertragsbedingungen des Fonds sind in ihrer gültigen Fassung beim Luxemburger Handelsregister zur Einsicht hinterlegt.

Die Vertragsbedingungen, der ausführliche Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie die Jahres- und Halbjahresberichte können direkt bei der Swisscanto Fondsleitung AG, am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Depotbank und des Vertreters in der Schweiz, bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle sowie bei allen Geschäftsstellen der Kantonalbanken und bei allen Zahl- und Vertriebsstellen kostenlos in Papierform bezogen werden. Außerdem stehen die Informationen auf der Homepage der Swisscanto (www.swisscanto.com) zur Verfügung, wo auch weitere aktuelle Angaben zum Fonds abrufbar sind.

Auf der Grundlage der Jahres- und Halbjahresberichte dürfen keine Zeichnungen von Fondsanteilen entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes und des letzten Jahresberichtes sowie, falls danach ein Halbjahresbericht ausgegeben wurde, dieses Halbjahresberichtes.

Verkaufsbeschränkungen

Die Anteile des Fonds dürfen innerhalb der USA oder Personen, die gemäß Regulation S des US Securities Act von 1933 oder gemäß US Commodity Exchange Act, jeweils in der aktuellen Fassung, als US-Personen gelten, weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

Gemäss den Verhaltensregeln der Asset Management Association Switzerland vom 5. August und 23. September 2021 (in Kraft 1. Januar 2022)

Aus der pauschalen Verwaltungskommission werden Vergütungen für den Vertrieb des Anlagefonds entrichtet. Die Swisscanto Asset Management International S.A. entrichtet zudem aus der pauschalen Verwaltungskommission Rückvergütungen an institutionelle Anleger, welche die Fondsanteile wirtschaftlich für Dritte halten.

Risikomanagementverfahren

Die Verwaltungsgesellschaft setzt für den Fonds und jeden Teilfonds ein Risikomanagementverfahren im Einklang mit dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 und sonstigen anwendbaren Vorschriften ein, insbesondere dem Rundschreiben 11/512 der CSSF. Im Rahmen des Risikomanagementverfahrens wird das Gesamtrisiko sämtlicher Teilfonds durch den sogenannten Commitment-Ansatz gemessen und kontrolliert.

3 Aktivitätsbericht

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets - USD

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution |
|--------|--------------|-----------|--------------|
| AT | LU0338548034 | 003650277 | Accumulate |
| BT | LU0999461055 | 23115375 | Accumulate |
| DT | LU0338548117 | 3650280 | Accumulate |
| DT EUR | LU2775729077 | 133252693 | Accumulate |
| GT | LU0866273294 | 20252840 | Accumulate |
| MT | LU2099034824 | 51747447 | Accumulate |
| NT | LU0866272569 | 20252839 | Accumulate |
| ST | LU2604819834 | 126041189 | Accumulate |

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - USD

| Klasse | ISIN | Valor | Distribution |
|--------|--------------|----------|--------------|
| AT | LU0562145853 | 12041875 | Accumulate |
| BT | LU0999461139 | 23115403 | Accumulate |
| DT | LU0562149921 | 12041876 | Accumulate |

4 Vermögensaufstellung

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection CHF | Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets USD | Konsolidiert CHF |
|---|-------------|---|--|---------------------|
| VERMÖGENSWERTE | | | | |
| Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekauft Optionen) zum Marktwert | (2,8) | 13'425'848 | 744'595'506 | 641'529'387 |
| Bankguthaben | | 164'545 | 18'627'177 | 15'877'501 |
| Forderungen aus Wertpapierverkäufen | | 0 | 5'482'480 | 4'624'746 |
| Forderung aus Devisenkäufen | | 10'000 | 29'728'714 | 25'087'656 |
| Ausstehende Zeichnungsbeträge | | 100 | 29'208 | 24'739 |
| Forderungen aus Swaps und Swaptions | | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Wertpapiererträgen | | 45'754 | 1'624'971 | 1'416'499 |
| Zinsforderungen aus Bankguthaben | | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | (6) | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften | (7) | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften | (9) | 23'505 | 0 | 23'505 |
| Sonstige Vermögenswerte | | 0 | 0 | 0 |
| SUMME DER VERMÖGENSWERTE | | 13'669'752 | 800'088'056 | 688'584'032 |
| VERBINDLICHKEITEN | | | | |
| Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert | (8) | 0 | 0 | 0 |
| Bankverbindlichkeiten | | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen | | 0 | -18'341'342 | -15'471'839 |
| Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen | | -9'919 | -29'743'790 | -25'100'293 |
| Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen | | 0 | -51'415 | -43'371 |
| Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions | | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | (6) | -6'771 | 0 | -6'771 |
| Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften | (7) | 0 | 0 | 0 |
| Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften | (9) | 0 | 0 | 0 |
| Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten | | -13'943 | -6'041'677 | -5'110'399 |
| SUMME DER VERBINDLICHKEITEN | | -30'633 | -54'178'224 | -45'732'674 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 13'639'120 | 745'909'832 | 642'851'359 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Entwicklung der Anzahl Anteile

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets - USD

| Klasse | Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende der Rechnungsperiode |
|--------|--|------------------------|----------------------------|--|
| AT | 134'991.465 | 17'047.670 | -8'487.109 | 143'552.026 |
| BT | 3'907.986 | 0.000 | 0.000 | 3'907.986 |
| DT | 248'357.428 | 43'013.668 | -48'678.411 | 242'692.685 |
| DT EUR | 74'883.129 | 0.000 | 0.000 | 74'883.129 |
| GT | 547'334.527 | 77'766.003 | -44'762.602 | 580'337.928 |
| MT | 6'040.000 | 0.000 | 0.000 | 6'040.000 |
| NT | 3'043'774.275 | 7'534.000 | -15'888.051 | 3'035'420.225 |
| ST | 879.000 | 70.000 | 0.000 | 949.000 |

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

| Klasse | Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode | Ausgegebene Anteile | Zurückgenommene Anteile | Bestand am Ende der Rechnungsperiode |
|--------|--|------------------------|----------------------------|--|
| AT | 144'524.143 | 366.205 | -15'905.643 | 128'984.704 |
| BT | 974.529 | 5.794 | 0.000 | 980.323 |
| DT | 4'650.000 | 0.000 | 0.000 | 4'650.000 |

5 Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens

| | Erläuterung | Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection CHF | Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets USD | Konsolidiert CHF |
|---|-------------|---|--|---------------------|
| NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES | | 14'844'064 | 638'325'501 | 598'784'232 |
| ERTRÄGE | | | | |
| Dividenden aus Wertpapierbestand, netto | | 52'131 | 10'999'657 | 9'330'891 |
| Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen | | 86'212 | 0 | 86'212 |
| Zinserträge aus Bankguthaben | | 2'346 | 275'151 | 234'450 |
| Zinsen aus Swaps, netto | | 17'927 | 0 | 17'927 |
| Erhaltene Kommissionen | (13) | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Erträge | | 0 | 0 | 0 |
| GESAMTERTRÄGE | | 158'616 | 11'274'808 | 9'669'480 |
| AUFWENDUNGEN | | | | |
| Transaktionskosten | | 0 | 0 | 0 |
| Pauschale Verwaltungskommission | (3) | -76'643 | -813'960 | -763'259 |
| Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") | (4) | -3'022 | -41'025 | -37'629 |
| Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten | | -58 | -9'969 | -8'468 |
| Zinsaufwendungen aus Swaps, netto | | -23'309 | 0 | -23'309 |
| Sonstige Aufwendungen | | 0 | 0 | 0 |
| GESAMTAUFWENDUNGEN | | -103'033 | -864'954 | -832'665 |
| ERTRAGSAUSGLEICH | | -3'463 | 29'643 | 21'543 |
| SUMME DER NETTOERTRÄGE | | 52'120 | 10'439'497 | 8'858'358 |
| Nettorealisierte Wertpapiererhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren | | -32'884 | -1'353'540 | -1'174'663 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps | | 0 | 0 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen | | -52'014 | 0 | -52'014 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften | | 51'313 | 25'778 | 73'058 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 |
| Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften | | -46'820 | -1'543'562 | -1'348'891 |
| NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN | | -28'286 | 7'568'173 | 6'355'847 |
| NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES | | | | |
| - aus Wertpapieren | | 358'377 | 88'123'372 | 74'694'848 |
| - aus Swaps | | 0 | 0 | 0 |
| - aus Termingeschäften | | 0 | 0 | 0 |
| - aus Devisentermingeschäften | | -8'725 | 0 | -8'725 |
| - aus Optionen | | 0 | 0 | 0 |
| NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS | | 321'366 | 95'691'545 | 81'041'969 |
| Zeichnung von Anteilen | (2) | 36'790 | 30'372'192 | 25'657'253 |
| Rücknahme von Anteilen | (2) | -1'566'563 | -18'449'763 | -17'129'861 |
| Ausschüttungen | | 0 | 0 | 0 |
| Ertragsausgleich | | 3'463 | -29'643 | -21'543 |
| Bewertungsdifferenz | (2) | | | -45'480'692 |
| NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES | | 13'639'120 | 745'909'832 | 642'851'359 |

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

6 Statistik

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets - USD

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|--------|----------------|----------------|----------------|
| Nettovermögen | | 745'909'832.13 | 638'325'501.03 | 482'291'447.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 168.50 | 148.08 | 139.87 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BT | 145.97 | 127.78 | 119.76 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 192.41 | 168.16 | 157.12 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT EUR | 111.50 | 100.70 | 0.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | GT | 154.11 | 134.58 | 125.56 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | MT | 125.69 | 109.34 | 101.24 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | NT | 150.76 | 131.12 | 121.36 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | ST | 123'615.24 | 107'511.11 | 0.00 |
| TER pro Anteil | AT | 2.05 | | |
| TER pro Anteil | BT | 1.28 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.96 | | |
| TER pro Anteil | DT EUR | 0.96 | | |
| TER pro Anteil | GT | 0.81 | | |
| TER pro Anteil | MT | 0.05 | | |
| TER pro Anteil | NT | 0.01 | | |
| TER pro Anteil | ST | 0.01 | | |

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

| | Klasse | Y | Y-1 | Y-2 |
|-------------------------------|--------|---------------|---------------|---------------|
| Nettovermögen | | 13'639'120.09 | 14'844'063.85 | 17'164'091.00 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | AT | 101.03 | 98.51 | 95.35 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | BT | 105.47 | 102.63 | 98.95 |
| Nettovermögenswert pro Anteil | DT | 108.59 | 105.57 | 101.59 |
| TER pro Anteil | AT | 1.15 | | |
| TER pro Anteil | BT | 0.75 | | |
| TER pro Anteil | DT | 0.56 | | |

7 Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Wertpapierbestand zum 30.09.2024 (Angaben in USD)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------------|-------------------------|---------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Aktien | | | | | | |
| AE | | | | | | |
| AEE000401019 | EMIRATES TELECOM GROUP CO | 1'449'339 | AED | 6'934'757 | 7'299'965 | 0.98 |
| AEA002001013 | ALDAR PROPERTIES PJSC | 3'239'017 | AED | 6'086'319 | 6'631'475 | 0.89 |
| AEA000201011 | ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 2'525'797 | AED | 6'042'817 | 5'790'147 | 0.78 |
| | | | | 19'063'893 | 19'721'587 | 2.65 |
| AT | | | | | | |
| AT0000652011 | ERSTE GROUP BANK AG | 191'337 | EUR | 9'241'687 | 10'516'894 | 1.41 |
| | | | | 9'241'687 | 10'516'894 | 1.41 |
| BR | | | | | | |
| BRWEGEACNORO | WEG SA | 656'745 | BRL | 4'721'109 | 6'559'249 | 0.88 |
| BRSPACNOR5 | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 478'817 | BRL | 7'017'211 | 7'948'338 | 1.07 |
| BRITUBACNPR1 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 440'983 | BRL | 2'681'032 | 2'924'069 | 0.39 |
| BRHYEACNORO | HYPERA SA | 1'075'384 | BRL | 6'902'678 | 5'179'647 | 0.69 |
| BRBBASACNOR3 | BANCO DO BRASIL S.A. | 1'588'645 | BRL | 7'218'696 | 7'928'931 | 1.06 |
| | | | | 28'540'725 | 30'540'234 | 4.09 |
| CA | | | | | | |
| CA46579R1047 | IVANHOE MINES LTD-CL A | 548'469 | CAD | 7'748'417 | 8'168'471 | 1.10 |
| | | | | 7'748'417 | 8'168'471 | 1.10 |
| CN | | | | | | |
| KYG9830F1063 | YADEA GROUP HOLDINGS LTD | 106'268 | HKD | 191'358 | 189'073 | 0.03 |
| KYG8918W1069 | TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT | 3'043'200 | HKD | 7'514'861 | 7'820'054 | 1.05 |
| KYG875721634 | TENCENT HOLDINGS LTD | 852'515 | HKD | 37'000'940 | 48'796'674 | 6.53 |
| KYG8208B1014 | JD.COM INC-CLASS A | 579'150 | HKD | 10'928'409 | 12'459'088 | 1.67 |
| KYG017191142 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 2'680'472 | HKD | 31'876'977 | 37'959'693 | 5.08 |
| HK0992009065 | LENOVO GROUP LTD | 8'588'000 | HKD | 9'609'205 | 11'719'704 | 1.57 |
| CNE100006M58 | MIDEA GROUP CO LTD | 436'000 | HKD | 3'831'573 | 4'167'750 | 0.56 |
| CNE1000048K8 | HAIER SMART HOME CO LTD-H | 2'869'000 | HKD | 9'556'410 | 11'524'017 | 1.54 |
| CNE100003662 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | 293'560 | CNY | 8'741'706 | 10'565'585 | 1.42 |
| CNE100002TP9 | PROYA COSMETICS CO LTD-A | 848'395 | CNY | 12'492'649 | 13'345'403 | 1.79 |
| CNE100001QQ5 | MIDEA GROUP CO LTD-A | 532'400 | CNY | 4'970'416 | 5'786'022 | 0.78 |
| CNE1000018M7 | SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | 667'680 | CNY | 6'466'686 | 9'500'057 | 1.27 |
| CNE1000003X6 | PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 3'327'371 | HKD | 18'199'324 | 21'482'801 | 2.88 |
| CNE1000002H1 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 22'721'000 | HKD | 14'819'582 | 17'199'804 | 2.31 |
| CNE000001KM8 | SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A | 379'900 | CNY | 3'734'694 | 4'011'432 | 0.54 |
| CNE000001G38 | NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | 3'037'381 | CNY | 8'764'621 | 12'008'649 | 1.61 |
| | | | | 188'699'410 | 228'535'806 | 30.63 |
| GB | | | | | | |
| GB00BMWC6P49 | MONDI PLC | 585'921 | GBP | 11'766'342 | 11'167'996 | 1.50 |
| | | | | 11'766'342 | 11'167'996 | 1.50 |
| ID | | | | | | |
| ID1000129000 | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 41'674'290 | IDR | 8'526'168 | 8'230'235 | 1.10 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------------|-------------------------|---------|--------------------|--------------------|---------------------------|
| ID1000118201 | BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 26'259'200 | IDR | 8'173'188 | 8'585'380 | 1.15 |
| ID1000109507 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 13'692'002 | IDR | 8'580'330 | 9'337'483 | 1.25 |
| | | | | 25'279'686 | 26'153'098 | 3.50 |
| IN | | | | | | |
| INE878B01027 | KEI INDUSTRIES LTD | 170'092 | INR | 6'869'441 | 8'722'263 | 1.17 |
| INE848E01016 | NHPC LTD | 6'583'955 | INR | 6'313'511 | 7'459'874 | 1.00 |
| INE758T01015 | ZOMATO LTD | 3'436'293 | INR | 7'418'068 | 11'206'744 | 1.50 |
| INE752E01010 | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | 2'537'688 | INR | 6'641'935 | 10'685'085 | 1.43 |
| INE742F01042 | ADANI PORTS AND SPECIAL ECON | 638'481 | INR | 10'513'680 | 11'033'827 | 1.48 |
| INE397D01024 | BHARTI AIRTEL LTD | 684'647 | INR | 10'329'467 | 13'966'840 | 1.87 |
| INE238A01034 | AXIS BANK LTD | 930'574 | INR | 11'705'451 | 13'683'014 | 1.83 |
| INE176B01034 | HAVELLS INDIA LTD | 319'414 | INR | 6'068'410 | 7'672'304 | 1.03 |
| INE090A01021 | ICICI BANK LTD | 827'777 | INR | 10'824'968 | 12'574'520 | 1.69 |
| INE044A01036 | SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 414'234 | INR | 9'333'776 | 9'523'783 | 1.28 |
| INE040A01034 | HDFC BANK LIMITED | 656'825 | INR | 12'289'843 | 13'575'622 | 1.82 |
| INE030A01027 | HINDUSTAN UNILEVER LTD | 350'776 | INR | 10'529'948 | 12'382'882 | 1.66 |
| INE009A01021 | INFOSYS LTD | 624'893 | INR | 11'594'096 | 13'986'064 | 1.88 |
| | | | | 120'432'594 | 146'472'821 | 19.64 |
| JO | | | | | | |
| GB00B0LCW083 | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 339'045 | GBP | 8'560'523 | 8'690'808 | 1.17 |
| | | | | 8'560'523 | 8'690'808 | 1.17 |
| KR | | | | | | |
| KR7105560007 | KB FINANCIAL GROUP INC | 148'040 | KRW | 6'598'419 | 9'158'381 | 1.23 |
| KR7021240007 | COWAY CO LTD | 138'996 | KRW | 6'022'361 | 7'089'559 | 0.95 |
| KR7005931001 | SAMSUNG ELECTRONICS-PREF | 147'389 | KRW | 6'625'828 | 5'736'856 | 0.77 |
| KR7005930003 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 444'304 | KRW | 22'992'085 | 20'895'195 | 2.80 |
| KR7005830005 | DB INSURANCE CO LTD | 115'640 | KRW | 6'792'795 | 9'930'679 | 1.33 |
| KR7000660001 | SK HYNIX INC | 97'388 | KRW | 12'362'320 | 13'002'917 | 1.74 |
| | | | | 61'393'808 | 65'813'586 | 8.82 |
| LU | | | | | | |
| LU0974299876 | GLOBANT SA | 29'670 | USD | 5'735'737 | 5'878'814 | 0.79 |
| | | | | 5'735'737 | 5'878'814 | 0.79 |
| MX | | | | | | |
| MXP370711014 | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 1'255'103 | MXN | 9'774'714 | 8'932'092 | 1.20 |
| MXP225611567 | CEMEX SAB-CPO | 7'151'724 | MXN | 5'241'017 | 4'400'050 | 0.59 |
| | | | | 15'015'731 | 13'332'142 | 1.79 |
| PE | | | | | | |
| BMG2519Y1084 | CREDICORP LTD | 68'784 | USD | 9'744'638 | 12'447'840 | 1.67 |
| | | | | 9'744'638 | 12'447'840 | 1.67 |
| PL | | | | | | |
| LU2237380790 | ALLEGRO.EU SA | 789'552 | PLN | 7'323'139 | 7'164'274 | 0.96 |
| | | | | 7'323'139 | 7'164'274 | 0.96 |
| TR | | | | | | |
| TREMGTI00012 | MIGROS TICARET A.S | 322'681 | TRY | 5'514'049 | 4'247'386 | 0.57 |
| | | | | 5'514'049 | 4'247'386 | 0.57 |
| TW | | | | | | |
| TW0006409006 | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY | 75'000 | TWD | 4'159'819 | 4'799'109 | 0.64 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|
| TW0002891009 | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 4'927'067 | TWD | 3'802'224 | 5'355'761 | 0.72 |
| TW0002454006 | MEDIATEK INC | 238'000 | TWD | 8'357'384 | 8'836'680 | 1.18 |
| TW0002383007 | ELITE MATERIAL CO LTD | 678'890 | TWD | 9'000'486 | 9'589'175 | 1.29 |
| TW0002345006 | ACCTON TECHNOLOGY CORP | 458'000 | TWD | 7'601'089 | 7'699'303 | 1.03 |
| TW0002330008 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 2'292'000 | TWD | 43'365'236 | 69'310'791 | 9.28 |
| TW0002308004 | DELTA ELECTRONICS INC | 1'034'000 | TWD | 9'379'812 | 12'432'243 | 1.67 |
| | | | | 85'666'051 | 118'023'062 | 15.81 |
| | US | | | | | |
| KYG114741062 | BIZLINK HOLDING INC | 526'131 | TWD | 5'109'600 | 7'664'240 | 1.03 |
| | | | | 5'109'600 | 7'664'240 | 1.03 |
| | ZA | | | | | |
| ZAE000200457 | MR PRICE GROUP LTD | 520'659 | ZAR | 5'092'609 | 8'164'369 | 1.09 |
| ZAE000134854 | CLICKS GROUP LTD | 435'746 | ZAR | 6'939'495 | 10'037'900 | 1.35 |
| ZAE000066692 | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 163'857 | ZAR | 1'649'107 | 1'854'178 | 0.25 |
| | | | | 13'681'211 | 20'056'446 | 2.69 |
| | Summe - Aktien | | | | 744'595'506 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 744'595'506 | |
| | An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | |
| | Aktien | | | | | |
| | HK | | | | | |
| KYG211311009 | CHINA METAL RECYCLING | 1'053'000 | HKD | 1'102'880 | 0 | 0.00 |
| | | | | 1'102'880 | 0 | 0.00 |
| | Summe - Aktien | | | | 0 | |
| | Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 0 | |
| | SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | 744'595'506 | 99.82 |

8 Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Wertpapierbestand zum 30.09.2024 (Angaben in CHF)

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|---|------------------------------|-------------------------|---------|---------------|----------------|---------------------------|
| Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | | | |
| Aktien | | | | | | |
| AU | | | | | | |
| AU000000SUN6 | SUNCORP GROUP LTD | 5'107 | AUD | 38'581 | 54'065 | 0.39 |
| | | | | 38'581 | 54'065 | 0.39 |
| CA | | | | | | |
| CA7751092007 | ROGERS COMMUNICATIONS INC-B | 553 | CAD | 25'229 | 18'777 | 0.14 |
| CA6330671034 | NATIONAL BANK OF CANADA | 564 | CAD | 41'028 | 44'986 | 0.33 |
| CA46579R1047 | IVANHOE MINES LTD-CL A | 2'938 | CAD | 29'980 | 36'911 | 0.27 |
| | | | | 96'238 | 100'674 | 0.74 |
| CH | | | | | | |
| CH1335392721 | GALDERMA GROUP AG | 140 | CHF | 11'143 | 11'004 | 0.08 |
| CH1243598427 | SANDOZ GROUP AG | 998 | CHF | 36'755 | 35'199 | 0.26 |
| CH1176493729 | BACHEM HOLDING AG | 205 | CHF | 15'543 | 14'596 | 0.11 |
| CH1175448666 | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 334 | CHF | 43'515 | 46'176 | 0.34 |
| CH1169151003 | FISCHER (GEORG)-REG | 280 | CHF | 18'461 | 17'878 | 0.13 |
| CH1101098163 | BELIMO HOLDING AG-REG | 54 | CHF | 23'321 | 32'589 | 0.24 |
| CH0435377954 | SIG GROUP AG | 2'143 | CHF | 49'226 | 40'417 | 0.29 |
| CH0432492467 | ALCON INC | 962 | CHF | 68'443 | 81'116 | 0.59 |
| CH0418792922 | SIKA AG-REG | 345 | CHF | 95'680 | 96'635 | 0.71 |
| CH0360674466 | GALENICA AG | 225 | CHF | 16'507 | 16'751 | 0.12 |
| CH0311864901 | VAT GROUP AG | 91 | CHF | 33'335 | 39'203 | 0.29 |
| CH0276534614 | ZEHNDER GROUP AG-RG | 305 | CHF | 22'505 | 16'897 | 0.12 |
| CH0244767585 | UBS GROUP AG-REG | 3'815 | CHF | 90'839 | 99'419 | 0.73 |
| CH0210483332 | CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 620 | CHF | 75'982 | 82'956 | 0.61 |
| CH0038863350 | NESTLE SA-REG | 3'023 | CHF | 340'697 | 256'834 | 1.87 |
| CH0025751329 | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 445 | CHF | 34'051 | 33'624 | 0.25 |
| CH0025536027 | BURCKHARDT COMPRESSION HOLDI | 31 | CHF | 18'676 | 18'786 | 0.14 |
| CH0025238863 | KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG | 93 | CHF | 25'103 | 21'464 | 0.16 |
| CH0024608827 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 56 | CHF | 57'850 | 71'120 | 0.52 |
| CH0018294154 | PSP SWISS PROPERTY AG-REG | 135 | CHF | 16'805 | 16'727 | 0.12 |
| CH0014852781 | SWISS LIFE HOLDING AG-REG | 82 | CHF | 43'283 | 57'892 | 0.42 |
| CH0014284498 | SIEGFRIED HOLDING AG-REG | 34 | CHF | 23'981 | 38'692 | 0.28 |
| CH0013841017 | LONZA GROUP AG-REG | 157 | CHF | 86'467 | 83'932 | 0.61 |
| CH0013396012 | SKAN GROUP AG | 290 | CHF | 23'367 | 23'113 | 0.17 |
| CH0012549785 | SONOVA HOLDING AG-REG | 148 | CHF | 39'754 | 44'962 | 0.33 |
| CH0012453913 | TEMENOS AG - REG | 115 | CHF | 8'351 | 6'808 | 0.05 |
| CH0012221716 | ABB LTD-REG | 2'685 | CHF | 94'362 | 131'538 | 0.96 |
| CH0012214059 | HOLCIM LTD | 456 | CHF | 29'964 | 37'647 | 0.27 |
| CH0012100191 | TECAN GROUP AG-REG | 97 | CHF | 33'265 | 27'005 | 0.20 |
| CH0012032048 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1'024 | CHF | 311'968 | 277'094 | 2.02 |
| CH0012005267 | NOVARTIS AG-REG | 2'702 | CHF | 213'427 | 262'499 | 1.92 |
| CH0011075394 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 269 | CHF | 109'089 | 137'136 | 1.00 |
| CH0010645932 | GIVAUDAN-REG | 16 | CHF | 53'297 | 74'240 | 0.54 |
| CH0006372897 | INTERROLL HOLDING AG-REG | 7 | CHF | 19'935 | 17'955 | 0.13 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| | | | | 2'184'945 | 2'269'905 | 16.58 |
| | DE | | | | | |
| DE000ENAG999 | E.ON SE | 3'813 | EUR | 43'013 | 47'941 | 0.35 |
| DE0008404005 | ALLIANZ SE-REG | 150 | EUR | 28'887 | 41'659 | 0.30 |
| DE0007236101 | SIEMENS AG-REG | 208 | EUR | 29'267 | 35'510 | 0.26 |
| DE0007164600 | SAP SE | 115 | EUR | 21'215 | 22'130 | 0.16 |
| | | | | 122'382 | 147'239 | 1.07 |
| | DK | | | | | |
| DK0062498333 | NOVO NORDISK A/S-B | 485 | DKK | 29'564 | 48'192 | 0.35 |
| | | | | 29'564 | 48'192 | 0.35 |
| | FR | | | | | |
| FR0000121972 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | 263 | EUR | 38'860 | 58'483 | 0.43 |
| FR0000120644 | DANONE | 609 | EUR | 33'510 | 37'462 | 0.27 |
| | | | | 72'370 | 95'945 | 0.70 |
| | GB | | | | | |
| IE00BDVJJQ56 | NVENT ELECTRIC PLC | 308 | USD | 19'961 | 18'254 | 0.13 |
| GB00BM8PJY71 | NATWEST GROUP PLC | 9'402 | GBP | 30'663 | 36'585 | 0.27 |
| GB00BDR05C01 | NATIONAL GRID PLC | 4'186 | GBP | 44'392 | 48'785 | 0.36 |
| GB00B10RZP78 | UNILEVER PLC | 1'046 | EUR | 48'646 | 57'272 | 0.42 |
| GB0009895292 | ASTRAZENECA PLC | 129 | GBP | 15'215 | 16'914 | 0.12 |
| GB0007099541 | PRUDENTIAL PLC | 2'514 | GBP | 18'887 | 19'758 | 0.14 |
| | | | | 177'765 | 197'569 | 1.44 |
| | IE | | | | | |
| IE00B4BNMY34 | ACCENTURE PLC-CL A | 159 | USD | 46'339 | 47'410 | 0.35 |
| | | | | 46'339 | 47'410 | 0.35 |
| | IT | | | | | |
| IT0004176001 | PRYSMIAN SPA | 676 | EUR | 24'340 | 41'494 | 0.30 |
| | | | | 24'340 | 41'494 | 0.30 |
| | JP | | | | | |
| JP3910660004 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | 700 | JPY | 12'646 | 21'594 | 0.16 |
| JP3890350006 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR | 2'400 | JPY | 30'767 | 43'097 | 0.31 |
| JP3571400005 | TOKYO ELECTRON LTD | 100 | JPY | 14'206 | 14'914 | 0.11 |
| JP3435000009 | SONY GROUP CORP | 2'500 | JPY | 51'336 | 40'949 | 0.30 |
| JP3201200007 | OLYMPUS CORP | 900 | JPY | 11'617 | 14'429 | 0.11 |
| JP3200450009 | ORIX CORP | 1'800 | JPY | 34'742 | 35'221 | 0.26 |
| | | | | 155'314 | 170'205 | 1.25 |
| | LU | | | | | |
| FR0014000MR3 | EUROFINS SCIENTIFIC | 253 | EUR | 19'531 | 13'553 | 0.10 |
| | | | | 19'531 | 13'553 | 0.10 |
| | NL | | | | | |
| NL0011794037 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 1'453 | EUR | 42'855 | 42'446 | 0.31 |
| NL0010773842 | NN GROUP NV | 833 | EUR | 35'220 | 35'117 | 0.26 |
| NL0010273215 | ASML HOLDING NV | 50 | EUR | 33'266 | 35'097 | 0.26 |
| | | | | 111'341 | 112'661 | 0.83 |
| | SE | | | | | |
| SE0020050417 | BOLIDEN AB | 1 | SEK | 39 | 29 | 0.00 |
| | | | | 39 | 29 | 0.00 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|------------------------------|-------------------------|---------|---------------|---------------|---------------------------|
| SG | | | | | | |
| SG1M31001969 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | 2'500 | SGD | 52'974 | 52'919 | 0.39 |
| | | | | 52'974 | 52'919 | 0.39 |
| US | | | | | | |
| US98419M1009 | XYLEM INC | 157 | USD | 18'595 | 17'883 | 0.13 |
| US92826C8394 | VISA INC-CLASS A SHARES | 211 | USD | 43'824 | 48'938 | 0.36 |
| US92537N1081 | VERTIV HOLDINGS CO-A | 466 | USD | 38'288 | 39'109 | 0.29 |
| US92532F1003 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 98 | USD | 25'177 | 38'447 | 0.28 |
| US92276F1003 | VENTAS INC | 328 | USD | 18'001 | 17'744 | 0.13 |
| US91324P1021 | UNITEDHEALTH GROUP INC | 125 | USD | 50'480 | 61'651 | 0.45 |
| US9113631090 | UNITED RENTALS INC | 84 | USD | 28'243 | 57'376 | 0.42 |
| US8923561067 | TRACTOR SUPPLY COMPANY | 85 | USD | 20'421 | 20'860 | 0.15 |
| US8835561023 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 43 | USD | 21'893 | 22'437 | 0.16 |
| US88162G1031 | TETRA TECH INC | 620 | USD | 24'756 | 24'665 | 0.18 |
| US8725901040 | T-MOBILE US INC | 306 | USD | 43'426 | 53'267 | 0.39 |
| US78409V1044 | S&P GLOBAL INC | 117 | USD | 45'816 | 50'988 | 0.37 |
| US75886F1075 | REGENERON PHARMACEUTICALS | 41 | USD | 34'674 | 36'358 | 0.27 |
| US74762E1029 | QUANTA SERVICES INC | 107 | USD | 26'071 | 26'911 | 0.20 |
| US7458671010 | PULTEGROUP INC | 293 | USD | 32'980 | 35'475 | 0.26 |
| US7427181091 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | 312 | USD | 45'780 | 45'584 | 0.33 |
| US6907421019 | OWENS CORNING | 348 | USD | 30'997 | 51'818 | 0.38 |
| US67066G1040 | NVIDIA CORP | 1'900 | USD | 60'161 | 194'637 | 1.42 |
| US65290E1010 | NEXTRACKER INC-CL A | 866 | USD | 34'591 | 27'380 | 0.20 |
| US6098391054 | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 27 | USD | 16'669 | 21'056 | 0.15 |
| US5951121038 | MICRON TECHNOLOGY INC | 195 | USD | 12'475 | 17'059 | 0.12 |
| US5949181045 | MICROSOFT CORP | 510 | USD | 134'965 | 185'120 | 1.35 |
| US5717481023 | MARSH & MCLENNAN COS | 166 | USD | 24'579 | 31'239 | 0.23 |
| US5324571083 | ELI LILLY & CO | 93 | USD | 31'404 | 69'502 | 0.51 |
| US4943681035 | KIMBERLY-CLARK CORP | 163 | USD | 20'748 | 19'563 | 0.14 |
| US4435106079 | HUBBELL INC | 123 | USD | 39'936 | 44'444 | 0.32 |
| US34959E1091 | FORTINET INC | 297 | USD | 15'416 | 19'429 | 0.14 |
| US3364331070 | FIRST SOLAR INC | 177 | USD | 21'680 | 37'243 | 0.27 |
| US29261A1007 | ENCOMPASS HEALTH CORP | 434 | USD | 25'745 | 35'380 | 0.26 |
| US2788651006 | ECOLAB INC | 85 | USD | 18'359 | 18'308 | 0.13 |
| US23331A1097 | DR HORTON INC | 323 | USD | 41'950 | 51'978 | 0.38 |
| US22788C1053 | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 89 | USD | 19'884 | 21'057 | 0.15 |
| US21874C1027 | CORE & MAIN INC-CLASS A | 744 | USD | 26'992 | 27'865 | 0.20 |
| US1273871087 | CADENCE DESIGN SYS INC | 90 | USD | 21'082 | 20'576 | 0.15 |
| US1167941087 | BRUKER CORP | 215 | USD | 11'561 | 12'525 | 0.09 |
| US11135F1012 | BROADCOM INC | 641 | USD | 73'903 | 93'273 | 0.68 |
| US1011371077 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | 561 | USD | 38'238 | 39'657 | 0.29 |
| US0640581007 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 917 | USD | 41'880 | 55'586 | 0.41 |
| US0382221051 | APPLIED MATERIALS INC | 255 | USD | 35'832 | 43'462 | 0.32 |
| US0378331005 | APPLE INC | 913 | USD | 134'202 | 179'448 | 1.31 |
| US0367521038 | ELEVANCE HEALTH INC | 80 | USD | 33'473 | 35'092 | 0.26 |
| US0311621009 | AMGEN INC | 220 | USD | 58'844 | 59'796 | 0.44 |
| US0231351067 | AMAZON.COM INC | 825 | USD | 116'254 | 129'672 | 0.95 |
| US02079K3059 | ALPHABET INC-CL A | 899 | USD | 111'038 | 125'773 | 0.92 |
| US0010551028 | AFLAC INC | 207 | USD | 12'327 | 19'522 | 0.14 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|-----------------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| IE00B8KQN827 | EATON CORP PLC | 158 | USD | 24'883 | 44'175 | 0.32 |
| IE000S9YS762 | LINDE PLC | 155 | USD | 47'699 | 62'350 | 0.45 |
| | | | | 1'856'193 | 2'391'679 | 17.45 |
| Summe - Aktien | | | | | 5'743'539 | |
| Anleihen | | | | | | |
| AU | | | | | | |
| XS2342206591 | WSTP 0.766 05/13/31 | 100'000 | EUR | 102'875 | 90'064 | 0.66 |
| AU35G0002579 | TCV 2 09/17/35 | 400'000 | AUD | 177'375 | 175'496 | 1.28 |
| | | | | 280'251 | 265'560 | 1.94 |
| CA | | | | | | |
| US30216BKF84 | EDC 4 3/4 06/05/34 | 200'000 | USD | 181'799 | 180'309 | 1.32 |
| CA135087D358 | CAN 2 3/4 12/01/48 | 150'000 | CAD | 128'919 | 87'656 | 0.64 |
| | | | | 310'718 | 267'965 | 1.96 |
| CL | | | | | | |
| XS2369244087 | CHILE 0.1 01/26/27 | 200'000 | EUR | 187'512 | 176'095 | 1.28 |
| | | | | 187'512 | 176'095 | 1.28 |
| DE | | | | | | |
| US515110BP87 | RENTEN 2 3/8 06/10/25 | 100'000 | USD | 100'472 | 83'279 | 0.61 |
| US500769GQ12 | KFW 2 05/02/25 | 200'000 | USD | 194'449 | 166'437 | 1.21 |
| US500769CG75 | KFW 2.6 06/20/37 | 50'000'000 | JPY | 511'860 | 355'587 | 2.58 |
| DE000A1RQEX0 | HESSEN 2 5/8 08/25/34 | 200'000 | EUR | 186'673 | 188'638 | 1.38 |
| DE0001102507 | DBR 0 08/15/30 | 100'000 | EUR | 83'512 | 84'347 | 0.62 |
| DE0001102432 | DBR 1 1/4 08/15/48 | 99'405 | EUR | 151'813 | 73'421 | 0.54 |
| | | | | 1'228'780 | 951'709 | 6.94 |
| DK | | | | | | |
| DK0009923807 | DGB 0 1/2 11/15/29 | 1'000'000 | DKK | 118'306 | 118'097 | 0.86 |
| | | | | 118'306 | 118'097 | 0.86 |
| FR | | | | | | |
| FR001400F6X7 | SOGRPR 3 1/2 05/25/43 EMTN | 200'000 | EUR | 188'641 | 186'168 | 1.36 |
| | | | | 188'641 | 186'168 | 1.36 |
| GB | | | | | | |
| XS2333299324 | IFFIM 1 04/21/26 GMTN | 100'000 | USD | 90'294 | 80'535 | 0.59 |
| US046353AX64 | AZN 2 1/8 08/06/50 | 100'000 | USD | 57'341 | 51'060 | 0.37 |
| AU3CB0251239 | LLOYDS 4 03/07/25 MTN | 100'000 | AUD | 73'130 | 58'290 | 0.43 |
| | | | | 220'766 | 189'885 | 1.39 |
| IS | | | | | | |
| XS2788435050 | ICELND 3 1/2 03/21/34 | 100'000 | EUR | 98'178 | 98'528 | 0.72 |
| | | | | 98'178 | 98'528 | 0.72 |
| JP | | | | | | |
| XS0241265445 | EJRAIL 4 1/2 01/25/36 | 200'000 | GBP | 333'505 | 216'457 | 1.58 |
| | | | | 333'505 | 216'457 | 1.58 |
| NL | | | | | | |
| XS2199719233 | BNG 0 1/8 07/09/35 | 250'000 | EUR | 262'802 | 178'775 | 1.30 |
| | | | | 262'802 | 178'775 | 1.30 |
| NO | | | | | | |
| XS2432567555 | DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN | 200'000 | EUR | 203'608 | 178'341 | 1.30 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|-------------------------|----------------------------|-------------------------|---------|------------------|------------------|---------------------------|
| XS2189767515 | KBN 1 1/8 06/14/30 REGS | 204'000 | USD | 184'125 | 148'827 | 1.09 |
| | NZ | | | 387'733 | 327'168 | 2.39 |
| XS2343772724 | ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN | 100'000 | EUR | 84'129 | 79'634 | 0.58 |
| | SE | | | 84'129 | 79'634 | 0.58 |
| XS2474788929 | KOMINS 2 3/4 03/01/25 REGS | 300'000 | USD | 252'958 | 251'162 | 1.83 |
| | SG | | | 252'958 | 251'162 | 1.83 |
| XS2310058891 | DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN | 300'000 | USD | 277'004 | 243'246 | 1.77 |
| | US | | | 277'004 | 243'246 | 1.77 |
| XS2439004685 | PLD 1 1/2 02/08/34 | 100'000 | EUR | 76'184 | 79'461 | 0.58 |
| XS0291949120 | T 5 1/2 03/15/27 | 150'000 | GBP | 230'172 | 172'418 | 1.26 |
| US94973VBF31 | ELV 5.1 01/15/44 | 100'000 | USD | 121'789 | 83'480 | 0.61 |
| US92826CAL63 | V 1.9 04/15/27 | 350'000 | USD | 343'666 | 282'122 | 2.06 |
| US92343VGK44 | VZ 3.4 03/22/41 | 250'000 | USD | 238'897 | 172'441 | 1.26 |
| US883556CL42 | TMO 2 10/15/31 | 100'000 | USD | 76'901 | 73'127 | 0.53 |
| US713448EP96 | PEP 2 7/8 10/15/49 | 200'000 | USD | 136'920 | 120'817 | 0.88 |
| US594918BR43 | MSFT 2.4 08/08/26 | 150'000 | USD | 151'737 | 123'464 | 0.90 |
| US594918BD56 | MSFT 3 3/4 02/12/45 | 450'000 | USD | 371'913 | 347'616 | 2.53 |
| US532457BY33 | LLY 2 1/4 05/15/50 | 100'000 | USD | 60'755 | 53'193 | 0.39 |
| US46647PBH82 | JPM 2.005 03/13/26 | 100'000 | USD | 83'670 | 83'221 | 0.61 |
| US172967MD09 | C 4.65 07/23/48 | 100'000 | USD | 101'281 | 79'768 | 0.58 |
| US09247XAQ43 | BLK 2.4 04/30/30 | 200'000 | USD | 157'100 | 154'468 | 1.13 |
| US04636NAE31 | AZN 1 3/4 05/28/28 | 100'000 | USD | 81'191 | 77'914 | 0.57 |
| US02079KAF49 | GOOGL 2.05 08/15/50 | 200'000 | USD | 112'669 | 105'179 | 0.77 |
| US001055AY85 | AFL 4 3/4 01/15/49 | 100'000 | USD | 88'757 | 79'568 | 0.58 |
| | XS | | | 2'433'602 | 2'088'255 | 15.24 |
| XS2707161308 | IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN | 1'000'000 | CNY | 123'413 | 122'131 | 0.89 |
| XS2288938546 | EBRD 2 01/21/25 GMTN | 1'000'000 | CNY | 140'889 | 120'597 | 0.88 |
| XS0307424274 | ASIA 2.35 06/21/27 GMTN | 30'000'000 | JPY | 288'137 | 187'233 | 1.37 |
| XS0282506657 | EIB 2.15 01/18/27 | 20'000'000 | JPY | 189'193 | 122'956 | 0.90 |
| US4581X0BX51 | IADB 3.2 08/07/42 | 100'000 | USD | 67'820 | 72'454 | 0.53 |
| EU000A3K4DD8 | EU 1 07/06/32 NGEU | 100'000 | EUR | 85'731 | 83'844 | 0.61 |
| | | | | 895'184 | 709'215 | 5.18 |
| Summe - Anleihen | | | | | 6'347'919 | |
| Optionen | | | | | | |
| CH | | | | | | |
| DE000FOHBFW9 | SMI 06/20/25 P10900 | 60 | CHF | 13'521 | 11'538 | 0.08 |
| DE000C763PD3 | SMI 03/21/25 P10900 | 60 | CHF | 9'621 | 6'114 | 0.04 |
| DE000C45KJF9 | SMI 12/20/24 P10600 | 60 | CHF | 10'341 | 2'034 | 0.01 |
| | | | | 33'484 | 19'686 | 0.13 |
| DE | | | | | | |
| DE000FOUHCM7 | SX5E 06/20/25 P4450 | 60 | EUR | 6'281 | 6'044 | 0.04 |
| DE000F0SDXJ2 | SX5E 03/21/25 P4450 | 40 | EUR | 3'596 | 2'467 | 0.02 |

| ISIN Nummer | Bezeichnung | Stückzahl / Nennwert | Währung | Einstandswert | Marktwert | % des Netto- vermögens |
|--------------|---|-------------------------|---------|------------------|-------------------|---------------------------|
| DE000C4R8V00 | SX5E 12/20/24 P4500 | 50 | EUR | 5'242 | 1'638 | 0.01 |
| | | | | 15'120 | 10'149 | 0.07 |
| | JP | | | | | |
| | NKY 03/14/25 P35000 | 1'000 | JPY | 6'231 | 6'929 | 0.05 |
| | | | | 6'231 | 6'929 | 0.05 |
| | US | | | | | |
| | SPX 03/21/25 P4950 | 200 | USD | 16'697 | 10'679 | 0.08 |
| | SPX 12/20/24 P4650 | 100 | USD | 8'342 | 1'341 | 0.01 |
| | SPX 06/20/25 P5050 | 200 | USD | 17'830 | 17'917 | 0.13 |
| | | | | 42'869 | 29'938 | 0.22 |
| | Summe - Optionen | | | | 66'702 | |
| | Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 12'158'160 | |
| | Anlagefonds | | | | | |
| | LU | | | | | |
| LU1877924016 | SWC (LU) BF Sustainable Global Credit NT | 8'641 | CHF | 1'003'881 | 910'338 | 6.63 |
| LU0866272569 | SWC (LU) EF Sustainable Emerging Markets NT | 2'810 | USD | 373'739 | 357'351 | 2.60 |
| | | | | 1'377'620 | 1'267'688 | 9.23 |
| | Summe - Anlagefonds | | | | 1'267'688 | |
| | SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES | | | | 13'425'848 | 97.96 |

9 Erläuterungen

Erläuterung 1: Finanzberichte

Die Berichte des Fonds werden gemäß den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen über Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt.

Erläuterung 2: Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung

Das Nettovermögen eines jeden Teilfonds bzw. einer jeden Anteilklasse entspricht der Differenz zwischen der Summe der Vermögenswerte des Teilfonds bzw. der Anteilklasse und der Summe der den Teilfonds bzw. die Anteilklasse betreffenden Verpflichtungen.

Das Gesamtnettovermögen des Fonds ist in CHF ausgedrückt. Zum Zweck dieser Berechnung werden die Nettovermögen eines jeden Teilfonds, falls diese nicht auf CHF lauten, zu den letzten bekannten Devisenmittelkursen per Abschlussdatum umgerechnet. Dieser Umrechnung wurden folgende Kurse zugrunde gelegt:

Devisenkurse

| | | |
|-----|--------------|-------------|
| CNY | 1.00 = CHF | 0.12053039 |
| HKD | 1.00 = CHF | 0.10859993 |
| KRW | 1.00 = CHF | 0.00064506 |
| TWD | 1.00 = CHF | 0.02665540 |
| EUR | 1.00 = CHF | 0.94144104 |
| IDR | 1.00 = CHF | 0.00005572 |
| INR | 1.00 = CHF | 0.01006608 |
| PLN | 1.00 = CHF | 0.21988635 |
| SEK | 100.00 = CHF | 8.32182400 |
| DKK | 100.00 = CHF | 12.62893900 |
| TRY | 1.00 = CHF | 0.02467440 |
| GBP | 1.00 = CHF | 1.13149579 |
| JPY | 100.00 = CHF | 0.58973000 |
| SGD | 1.00 = CHF | 0.65799532 |
| ZAR | 1.00 = CHF | 0.04895111 |
| AUD | 1.00 = CHF | 0.58521281 |
| BRL | 1.00 = CHF | 0.15489919 |
| CAD | 1.00 = CHF | 0.62441245 |
| MXN | 1.00 = CHF | 0.04303387 |
| USD | 1.00 = CHF | 0.84355000 |
| AED | 1.00 = CHF | 0.22966240 |

Zeichnungen, Rücknahmen und Konversionen erfolgen auf Basis eines unbekanntes Nettovermögenswertes.

Bewertungsgrundsätze:

a) Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, welche an einer Börse notiert sind, werden zu den letztbekanntes Marktpreisen bewertet. Falls diese Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen an mehreren Börsen notiert sind, ist der letztverfügbare Kurs an jener Börse maßgebend, die der Hauptmarkt für dieses Wertpapier ist. Bei Wertpapieren, Derivaten und anderen Anlagen, bei welchen der Handel an einer Börse geringfügig ist und für welche ein Zweitmarkt zwischen Wertpapierhändlern mit marktkonformer Preisbildung besteht, kann die Verwaltungsgesellschaft die Bewertung dieser Wertpapiere, Derivate und anderen Anlagen aufgrund dieser Preise vornehmen, Wertpapiere, Derivate und andere

Anlagen, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist, gehandelt werden, werden zum letztverfügbaren Kurs auf diesem Markt bewertet.

b) Wertpapiere und andere Anlagen, welche weder an einer Börse notiert sind noch an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zum letzten erhältlichen Marktpreis bewertet. Ist ein solcher nicht verfügbar, erfolgt die Bewertung der Wertpapiere durch die Verwaltungsgesellschaft gemäß anderen durch den Verwaltungsrat festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage des voraussichtlich möglichen Verkaufspreises, dessen Wert mit der gebührenden Sorgfalt und nach bestem Wissen veranschlagt wird.

c) Geldmarktinstrumente, die nicht an einer Börse notiert sind, die aber an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist, gehandelt werden, können wie folgt bewertet werden: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanzhaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst.

d) Die liquiden Mittel, Treuhand- und Festgelder werden zum Nennwert zuzüglich aufgelaufener Zinsen bewertet.

e) Anteile an OGAW und anderer OGA werden nach ihrem letzten veröffentlichten Nettovermögenswert bewertet. Falls kein Nettovermögenswert zur Verfügung steht, sondern lediglich An- und Verkaufspreise, so können die Anteile solcher OGAW und anderer OGA zum Mittelwert zwischen solchen An- und Verkaufspreisen bewertet werden. Sind keine aktuellen Preise verfügbar, erfolgt die Bewertung durch die Verwaltungsgesellschaft gemäß anderen durch den Verwaltungsrat festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage des voraussichtlich möglichen Verkaufspreises, dessen Wert mit der gebührenden Sorgfalt und nach bestem Wissen veranschlagt wird.

f) Derivate, die weder an einer Börse noch an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, sind mit dem Verkehrswert (Fair Value) zu bewerten, der bei sorgfältiger Einschätzung unter Berücksichtigung der Gesamtumstände angemessen ist.

g) Für jeden Teilfonds werden die Werte, die auf eine andere Währung als diejenige des Teilfonds lauten, zum jeweiligen Mittelkurs in die Währung des Teilfonds umgerechnet. Zur Absicherung des Währungsrisikos werden abgeschlossene Terminkontrakte bei der Umrechnung berücksichtigt.

h) Dividenden werden am „Ex-dividend“ Datum gebucht und Zinsen werden täglich abgegrenzt.

i) Die realisierten Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf Basis des durchschnittlichen Anschaffungspreises errechnet.

j) Berechnung des Nettoinventarwertes

Der Nettovermögenswert der Anteile wird von der Verwaltungsgesellschaft für jeden einzelnen Teilfonds den Vertragsbedingungen und gemäß Ziffer 3.1 des Verkaufsprospektes an jedem Bankgeschäftstag in Luxemburg berechnet.

k) Bewertung der Devisentermingeschäfte

Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Berichtszeitpunkt aus der Bewertung von offenen Devisentermingeschäften ergeben, sind in der Vermögensaufstellung und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung berücksichtigt.

l) Kapitalgewinne oder -verluste aus Wertpapiergeschäften

Die realisierten Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf Basis des durchschnittlichen Anschaffungspreises errechnet.

m) Partial Swinging Single Prices (PSSP)

Für alle Teilfonds wird die PSSP-Methode angewandt. Bei der PSSP-Methode werden bei der Berechnung des Nettoinventarwertes die durch die Zeichnungen und Rücknahmen verursachten Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen (Geld/Brief-Spannen, marktconforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.) mitberücksichtigt. Falls an einem Bankgeschäftstag die Summe der Zeichnungen bzw. Rücknahmen aller Anteilsklassen eines Teilfonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, welcher einen bestimmten Schwellenwert (dargestellt in Prozent des Nettovermögenswertes) überschreitet, wird der Nettovermögenswert des betreffenden Teilfonds erhöht bzw. reduziert. Diese Summe wird als «modifizierter Nettoinventarwert» bezeichnet. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettovermögenswertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl der Anteile des betroffenen Teilfonds führen. Sie resultiert in einer Verminderung des Nettovermögenswertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken.

Die durch Zeichnungen und Rücknahmen am Handelstag verursachten Transaktionskosten sind von jenen Anlegern zu tragen, die diese Transaktionen in Auftrag geben.

Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen anfallende Zu- bzw. Abschlag bei den Transaktionskosten erfolgt jeweils pauschal und bezieht sich auf einen Durchschnittswert aus einer Vorperiode von maximal einem Jahr. Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettovermögenswertes des Teilfonds.

Falls der Fonds weniger als ein Jahr auf dem Markt ist, wird dieser Faktor je nach den Besonderheiten des Fonds so festgelegt, dass ein repräsentativer Wert resultiert.

Erläuterung 3: Verwaltungskommission

Dem Fonds wird für die Leitung und Verwaltung sowie den Vertrieb der Fondsanteile eine an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende pauschale Verwaltungskommission in Rechnung gestellt.

Die pauschale Verwaltungskommission setzt sich aus den zwei Bestandteilen pauschale Management Fee (Kosten für das Asset Management und für den Vertrieb) und pauschale Administration Fee (Kosten für die Verwaltung) zusammen. Die pauschale Verwaltungskommission wird pro rata temporis bei jeder Berechnung des Nettovermögenswertes dem Fondsvermögen belastet und jeweils am Ende eines Monats ausbezahlt.

Im Geschäftsjahr belief sich die effektive pauschale Verwaltungskommission auf:

| Teilfonds | Klasse | PVK p.a. in % | PMF p.a. in % | PAF p.a. in % |
|--|--------|---------------|---------------|---------------|
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | AT | 2.000 | 1.550 | 0.450 |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | BT | 1.230 | 0.780 | 0.450 |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | DT | 0.950 | 0.720 | 0.230 |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | DT EUR | 0.950 | 0.720 | 0.230 |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | GT | 0.800 | 0.570 | 0.230 |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | MT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | NT | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | ST | - | - | - |
| Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection | AT | 1.100 | 0.800 | 0.300 |
| Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection | BT | 0.700 | 0.400 | 0.300 |
| Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection | DT | 0.550 | 0.400 | 0.150 |

PVK= pauschale Verwaltungskommission / PMF= pauschale Management Fee / PAF= pauschale Administration Fee

Erläuterung 4: Abonnementsteuer („taxe d'abonnement“)

Gemäß den in Luxemburg geltenden Bestimmungen unterliegt der Fonds einer vierteljährlich zahlbaren „Taxe d'abonnement“ in Höhe von 0,05% p.a. für die Anteile der Anteilklassen A, B, C und M und in Höhe von 0,01% p.a. für die Anteile der Anteilklassen D, G, N und S, die auf der Grundlage des Nettovermögens eines jeden Teilfonds am Ende des jeweiligen Quartals berechnet wird.

Gemäß Artikel 175a des geänderten Gesetzes vom 17. Dezember 2010 ist der Teil des Nettovermögens, der in OGAW! angelegt ist, die bereits zur Zahlung der Kapitalsteuer verpflichtet sind, von dieser Steuer befreit.

Erläuterung 5: Total Expense Ratio (TER)

Die unter 'Statistik' dieses Berichts ausgewiesene TER wurde gemäß den «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. Der Ausweis der PTR im Jahresbericht ist nicht mehr zwingend notwendig. Die TER ist für die letzten 12 Monate berechnet, die dem Datum dieses Berichts vorausgingen.

Total Expense Ratio (TER) = (Betriebsaufwand / durchschnittliches Nettovermögen) x 100

Im Betriebsaufwand sind sämtliche dem Fonds belastete Kommissionen und Kosten erfasst. Nicht zum Betriebsaufwand gehören die Nebenkosten, die dem Fonds beim Kauf und Verkauf von Anlagen entstanden sind.

Erläuterung 6: Angaben über Devisentermingeschäfte

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

| Währung | Käufe | Währung | Verkäufe | Fälligkeit | Nicht realisiertes Ergebnis (in USD) |
|---------|--------------|---------|----------------|------------|--------------------------------------|
| CHF | 112'995.73 | DKK | 900'000.00 | 3.12.2024 | -246.64 |
| CHF | 200'423.65 | AUD | 350'000.00 | 3.12.2024 | -3'145.59 |
| CHF | 239'579.78 | CNY | 2'000'000.00 | 3.12.2024 | -1'097.83 |
| CHF | 156'302.25 | CAD | 250'000.00 | 3.12.2024 | 1'017.18 |
| CHF | 1'871'156.00 | EUR | 2'000'000.00 | 3.12.2024 | -3'714.01 |
| CHF | 4'075'843.00 | USD | 4'850'000.00 | 3.12.2024 | 12'268.47 |
| CHF | 443'266.40 | GBP | 400'000.00 | 3.12.2024 | -6'171.58 |
| CHF | 643'971.55 | JPY | 110'000'000.00 | 3.12.2024 | -5'680.69 |

Die Devisentermingeschäfte wurden mit folgender Gegenparteien abgeschlossen:
CACEIS Investor Services Bank SA/LU,
Zürcher Kantonalbank

Erläuterung 7: Angaben über Termingeschäfte

In der Berichtsperiode nicht relevant.

Erläuterung 8: Eventualverpflichtungen aus Optionen

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

| Währung | Put/Call | Strike | Anzahl Kontrakte | Fälligkeit | Bezeichnung | Marktwert |
|---------|----------|-----------|------------------|------------|---------------------------------|-----------|
| USD | Put | 5'050.00 | 2 | 20.06.2025 | S&P 500 PR | 17'917.00 |
| CHF | Put | 10'900.00 | 6 | 20.06.2025 | Swiss Market Index SMI PR | 11'538.00 |
| EUR | Put | 4'450.00 | 6 | 20.06.2025 | EURO STOXX 50 PR (Not Licensed) | 6'044.05 |
| EUR | Put | 4'450.00 | 4 | 21.03.2025 | EURO STOXX 50 PR (Not Licensed) | 2'466.58 |
| CHF | Put | 10'600.00 | 6 | 20.12.2024 | Swiss Market Index SMI PR | 2'034.00 |
| CHF | Put | 10'900.00 | 6 | 21.03.2025 | Swiss Market Index SMI PR | 6'114.00 |
| JPY | Put | 35'000.00 | 1 | 14.03.2025 | Nikkei 225 PR | 6'929.33 |
| USD | Put | 4'650.00 | 1 | 20.12.2024 | S&P 500 PR | 1'341.24 |
| EUR | Put | 4'500.00 | 5 | 20.12.2024 | EURO STOXX 50 PR (Not Licensed) | 1'638.11 |
| USD | Put | 4'950.00 | 2 | 21.03.2025 | S&P 500 PR | 10'679.34 |

Die Termingeschäfte wurden mit folgender Gegenparteien abgeschlossen: J.P. Morgan Securities PLC

Erläuterung 9: Swapgeschäfte

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

Interest rate swap

| Währung | Nominal | Bezeichnung | Währung | Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF) |
|---------|-------------|--------------------------------------|---------|--------------------------------------|
| Verkauf | (1'000'000) | IRS Floating Leg - USD-SOFR-COMPOUND | USD | -843'550.00 |
| Kauf | 1'000'000 | IRS Fix Leg 4.14334% p.a USD | USD | 867'054.55 |

Erläuterung 10: Wertpapierbestandsveränderungen

Informationen zu den Wertpapierbestandsveränderungen, die sich auf den Berichtszeitraum beziehen, stehen allen Anteilhabern auf der Homepage der Swisscanto (www.swisscanto.com) zur Verfügung oder können direkt bei der Swisscanto Asset Management AG, am Sitz der Verwaltungsgesellschaft, der Verwahrstelle und des Vertreters in der Schweiz, bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle sowie bei allen Geschäftsstellen der Kantonalbanken und bei allen Zahl- und Vertriebsstellen kostenlos bezogen werden.

Erläuterung 11: Steuerlich relevante Angaben für die Anleger in der Bundesrepublik Deutschland (nach §5 Investmentsteuergesetz Abs.1 Satz 1 Nr. 1)

Die Bekanntmachung dieser Angaben erfolgte durch Veröffentlichung im elektronischen Bundesanzeiger. Ferner stehen sie auf der Homepage von Swisscanto (www.swisscanto.lu) zur Verfügung. Anleger sollten ihren eigenen Steuerberater konsultieren, um sich über die eventuellen steuerlichen Konsequenzen beraten zu lassen, die sich aus dem Erwerb, dem Besitz, der Übertragung oder Veräußerung von Anteilen gemäß den Gesetzen der Länder, deren Staatsangehörigkeit sie besitzen oder in denen sie wohnhaft oder ansässig sind, ergeben könnten.

Erläuterung 12: Transaktionskosten

Transaktionskosten werden nur in Jahresbericht angezeigt.

Erläuterung 13: Wertpapierleihe (Securities Lending)

Keinen Securities Lending vorhanden.

Erläuterung 14: Gebühren bei Zeichnung und Rückkauf von Zielfonds

Gemäss dem abgeänderten Gesetz von 2010, wurden für die Zeichnung oder den Rückkauf von Anteilen von Zielfonds, die von derselben Verwaltungsgesellschaft oder einer anderen Gesellschaft verwaltet werden, die mit der Verwaltungsgesellschaft verbunden ist, keine Gebühren berechnet.

Einige Teilfonds des Umbrella investieren in andere Teilfonds des Umbrella. Der Wert dieser Anlagen (sog. cross investments) beläuft sich per Bericht auf:

| Zielfonds | Marktwert (in CHF) |
|--|--------------------|
| Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit | 1'914'218.31 |
| Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets | 731'089.68 |

Erläuterung 15: Zusätzliche Informationen

In der Berichtsperiode nicht relevant.

Erläuterung 16: Wichtige Ereignisse

Im Februar 2022 verhängten mehrere Länder (darunter die USA, das Vereinigte Königreich und die EU) aufgrund der offiziellen Anerkennung der Volksrepubliken Donezk und Lugansk durch die Russische Föderation Sanktionen gegen bestimmte Einrichtungen und Personen in Russland. Nach den von Russland am 24. Februar 2022 eingeleiteten Militäroperationen gegen die Ukraine wurden mögliche weitere Sanktionen angekündigt.

Aufgrund der zunehmenden geopolitischen Spannungen kam es seit Februar 2022 zu einem erheblichen Anstieg der Volatilität an den Wertpapier- und Devisenmärkten sowie zu einer deutlichen Abwertung des Rubels gegenüber dem US-Dollar und dem Euro. Es wird erwartet, dass diese Ereignisse die Aktivitäten russischer Unternehmen in verschiedenen Wirtschaftssektoren beeinträchtigen können.

Das Unternehmen betrachtet diese Ereignisse als nicht zu berücksichtigende Ereignisse nach dem Berichtszeitraum. Obwohl zum Zeitpunkt dieses Berichts weder die Leistung der Gesellschaft noch die Unternehmensfortführung oder die Geschäftstätigkeit von den oben genannten Ereignissen beeinflusst wurden, überwacht der Verwaltungsrat weiterhin die sich entwickelnde Situation und ihre Auswirkungen auf die Finanzlage und die Ergebnisse der Gesellschaft.

Erläuterung 17: Nachfolgende Ereignisse

In der Berichtsperiode nicht relevant.

10 Ungeprüfte Informationen

Verordnung über Wertpapierfinanzierungstransaktionen (EU-Verordnung Nr. 2015/2365)

Während des Zeitraums, auf den sich dieser Bericht bezieht, hat die Gesellschaft bei Transaktionen, die Gegenstand der EU-Verordnung sind Nr. 2015/2365 zur Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Wiederverwendung. Dementsprechend sind keine globalen, Konzentrations- oder Transaktionsdaten oder Informationen über die Wiederverwendung oder Verwahrung von Sicherheiten berichtet.