

---

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Un fonds d'investissement selon la première  
partie de la loi luxembourgeoise, sous la forme  
juridique d'un Fonds Commun de Placement  
(FCP)

---

### **Rapport annuel révisé au 31 mars 2020**

Société de gestion: SWISSCANTO ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL S.A.

R.C.S. B-121 904

Banque dépositaire: RBC Investor Services Bank S.A.

Les souscriptions ne peuvent être acceptées sur la base de rapports annuels et semi-annuels.

Les souscriptions sont uniquement effectuées sur la base du prospectus actuel accompagné du dernier rapport annuel, ainsi que, le cas échéant, du dernier rapport semi-annuel.

---

# Swisscanto (LU) Portfolio Fund

## Table des matières

	<b>Page</b>
<b>Organisation</b>	<b>4</b>
<b>Informations Générales</b>	<b>6</b>
<b>Rapport d'activité</b>	<b>7</b>
<b>Etat du patrimoine</b>	<b>41</b>
<b>Etat des opérations et des autres variations de l'actif net</b>	<b>45</b>
<b>Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020</b>	<b>50</b>
<b>Statistiques</b>	<b>56</b>
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced</b>	<b>74</b>
Etat du portefeuille-titres	74
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	81
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)</b>	<b>82</b>
Etat du portefeuille-titres	82
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	92
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)</b>	<b>93</b>
Etat du portefeuille-titres	93
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	105
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)</b>	<b>106</b>
Etat du portefeuille-titres	106
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	116
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)</b>	<b>117</b>
Etat du portefeuille-titres	117
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	132
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)</b>	<b>133</b>
Etat du portefeuille-titres	133
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	147
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)</b>	<b>148</b>
Etat du portefeuille-titres	148
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	158
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)</b>	<b>159</b>
Etat du portefeuille-titres	159
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	174
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)</b>	<b>175</b>
Etat du portefeuille-titres	175
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	189
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)</b>	<b>190</b>
Etat du portefeuille-titres	190
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	199
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)</b>	<b>200</b>
Etat du portefeuille-titres	200
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	213

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Table des matières (suite)

	<b>Page</b>
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)</b>	<b>214</b>
Etat du portefeuille-titres	214
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	226
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)</b>	<b>227</b>
Etat du portefeuille-titres	227
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	235
<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)</b>	<b>236</b>
Etat du portefeuille-titres	236
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	248
<b>Notes aux Etats Financiers</b>	<b>249</b>
<b>Informations non révisées complémentaires</b>	<b>271</b>
<b>Rapport du Réviseur d'Entreprises agréé</b>	<b>277</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Organisation

#### **Société de Gestion**

Swisscanto Asset Management International S.A.  
19, rue de Bitbourg, L-1273 Luxembourg

#### **Conseil d'Administration**

##### **Président**

Hans Frey, Suisse, Directeur général Swisscanto Fondsleitung AG, Zurich

##### **Membres**

Richard Goddard, Luxembourg, Administrateur de sociétés indépendant, The Director's Office, Luxembourg

Roland Franz, Luxembourg, Directeur général, Swisscanto Asset Management International S.A., Luxembourg

René Beeler, Suisse, Responsable du développement commercial, Zürcher Kantonalbank, Zurich (jusqu'au 31/07/2019)

Martin Friedli, Suisse, Directeur de la gestion des produits Fonds, Zürcher Kantonalbank, Zurich (depuis le 16/09/2019)

Anne-Marie Arens, Luxembourg, Administratrice de sociétés indépendante, Luxembourg

##### **Gestion**

Roland Franz, Luxembourg

Michael Weiß, Allemagne

##### **Dépositaire, Agent payeur principal, Administration centrale, Agent de Registre et Agent de Transfert**

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

##### **Gestionnaire**

Zürcher Kantonalbank,  
Bahnhofstrasse 9, CH-8001 Zurich, Suisse

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Organisation (suite)

#### **Agents payeurs et distributeurs**

##### **Allemagne**

DekaBank  
Deutsche Girozentrale  
Mainzer Landstrasse 16, D-60325 Francfort-sur-le-Main  
(« l'agent payeur et d'information en Allemagne »)

##### **Liechtenstein**

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

##### **Luxembourg**

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

##### **Autriche**

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

##### **Agent payeur en Suisse**

Basler Kantonalbank  
Spiegelgasse 2, CH-4002 Bâle

##### **Représentant en Suisse**

Swisscanto Fondsleitung AG  
Bahnhofstrasse 9, CH-8001 Zurich

##### **Dépôt central**

Clearstream Funds Centre Limited  
11 Westferry Circus, 2nd Floor, Westferry House, Canary Wharf, Londres, E14 4HE

##### **Réviseur d'entreprises indépendant**

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

##### **Conseillers juridiques**

Arendt & Medernach S.A.  
41A, Avenue John F. Kennedy, L-2082 Luxembourg

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations générales

#### **Liquidation de compartiments**

Les compartiments suivants ont été liquidés le 24 septembre 2019:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)

#### **Fonds de placement de droit luxembourgeois à compartiments multiples (« Umbrella Construction »)**

Swisscanto (LU) Portfolio Fund est soumis aux dispositions légales de la première partie de la loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 relative aux Organismes de placement collectif.

Le règlement du Fonds a été défini le 14 novembre 1994 par la société de gestion. Plusieurs modifications ont vu le jour, lesquelles ont été publiées dans le « Mémorial » conformément au règlement.

Les statuts de la société de gestion et le règlement du Fonds, ainsi que leurs modifications, sont déposés pour consultation dans leur forme valable auprès du greffe du Tribunal d'arrondissement de Luxembourg.

Le règlement, le prospectus, les informations clés pour l'investisseur ainsi que les rapports annuels et semestriels sont disponibles, gratuitement, au format papier, auprès de Swisscanto Fondsleitung AG, au siège de la société de gestion, de la banque dépositaire et de son représentant en Suisse, auprès de l'agent payeur et d'information en Allemagne, ainsi qu'auprès de toutes les agences des Banques Cantonales et de tous les agents payeurs et distributeurs. Par ailleurs, les informations sont disponibles sur le site internet de Swisscanto ([www.swisscanto.com](http://www.swisscanto.com)) où d'autres données actuelles concernant le Fonds peuvent être consultées.

Les souscriptions des parts du Fonds ne peuvent être acceptées sur la base de rapports annuels et semi-annuels. Les souscriptions de parts ne peuvent être effectuées que sur la base du prospectus en vigueur et du dernier rapport annuel, ainsi que, le cas échéant, de tout rapport semi-annuel publié ultérieurement.

#### **Restrictions de vente**

Les parts du Swisscanto (LU) Portfolio Fund ne peuvent être acquises, vendues ni livrées sur le territoire des États-Unis.

#### **Directive de la Swiss Funds and Asset Management Association (SFAMA) concernant les obligations liées à la perception de frais et à l'imputation de coûts, ainsi qu'à leur utilisation (22 mai 2014)**

Des indemnités pour la commercialisation du Fonds sont payées à partir des frais d'administration centrale. Swisscanto Asset Management International S.A. verse par ailleurs des rétrocessions, prélevées sur les frais d'administration centrale, aux investisseurs institutionnels qui détiennent des parts du fonds pour le compte de tiers.

#### **Procédure de gestion des risques**

La société de gestion met en œuvre une procédure de gestion des risques pour le Fonds et pour chaque compartiment, conformément à la loi du 17 décembre 2010 et aux autres dispositions applicables, en particulier à la circulaire 11/512 de la CSSF. Dans le cadre de la procédure de gestion des risques, le risque global de l'ensemble des compartiments est mesuré et contrôlé par ce qu'il est convenu d'appeler l'approche par les engagements (Commitment).

# Swisscanto (LU) Portfolio Fund

## Rapport d'activité

### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

#### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

#### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). En Suisse, le rendement des emprunts de la Confédération à dix ans est resté stable à -0,4%. Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en CHF a cédé 13%, contre plus de 20% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en CHF. Le marché actions suisse a mieux résisté avec un gain de 0,7% (SPI).

#### Aperçu des performances

Le fonds a dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) et la sous-pondération des emprunts périphériques européens ont exercé une influence négative. Au niveau des actions, la performance absolue des marchés développés et émergents a été négative. En revanche, les deux stratégies ont affiché une performance relative positive de près de 3%. La surpondération du secteur des technologies de l'information et la sous-pondération de l'énergie ont eu un effet favorable.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0136171393
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0161535165
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999466872

Numéro de valeur:	Classe AA:	1289514
Numéro de valeur:	Classe AT:	1544238
Numéro de valeur:	Classe BT:	23108298

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-7,60%
	Classe AT:	-7,60%
	Classe BT:	-7,04%



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en EUR a cédé 8,3%, contre près de 16% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en EUR.

##### Aperçu des performances

Le fonds a dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) et la sous-pondération des emprunts périphériques européens ont exercé une influence négative. Au niveau des actions, la performance absolue des marchés développés et émergents a été négative. En revanche, les deux stratégies ont affiché une performance relative positive de près de 3%. La surpondération du secteur des technologies de l'information et la sous-pondération de l'énergie ont eu un effet favorable.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0208341965
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0208341536
Numéro ISIN:	Classe DA:	LU1813277669

Numéro de valeur:	Classe AA:	2021554
Numéro de valeur:	Classe AT:	2021557
Numéro de valeur:	Classe DA:	41564045

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-4,66%
	Classe AT:	-4,66%
	Classe DA*:	-3,94%

\* La performance des classes de parts institutionnelles est calculée sur la base de la valeur d'évaluation de l'actif net (valeur nette d'inventaire « unswung »). La performance des autres catégories est en revanche calculée sur la base de la valeur de l'actif net modifiée (valeur nette d'inventaire « swung »).

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds. Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). En Suisse, le rendement des emprunts de la Confédération à dix ans est resté stable à -0,4%. Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en CHF a cédé 13%, contre plus de 20% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en CHF. Le marché actions suisse a mieux résisté avec un gain de 0,7% (SPI).

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la qualité plus élevée des positions par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet favorable. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0112799969
Numéro ISIN:	Classe AA EUR*:	LU1547437829
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0161539076
Numéro ISIN:	Classe AT EUR*:	LU1547438041
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999465718

Numéro de valeur:	Classe AA:	1092976
Numéro de valeur:	Classe AA EUR:	35264802
Numéro de valeur:	Classe AT:	1544205
Numéro de valeur:	Classe AT EUR:	35264803
Numéro de valeur:	Classe BT:	23108078

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-3,41%
	Classe AA EUR:	7,97%
	Classe AT:	-3,41%
	Classe AT EUR:	9,59%
	Classe BT:	-3,07%

\* La classe est inactive depuis le 18/02/2020.

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds. Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en EUR a cédé 8,3%, contre près de 16% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en EUR.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la sous-pondération des emprunts périphériques européens par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet négatif. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU1775789594
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU1775789677
Numéro de valeur:	Classe AA:	40488081
Numéro de valeur:	Classe AT:	40488082

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-2,89%
	Classe AT:	-2,89%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### **Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)\***

##### **Rétrospective de marché**

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit.

##### **Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds**

L'évolution des marchés a été dictée en grande partie par la politique accommodante des banques centrales. Les marchés actions ont progressé d'environ 4,6% à l'aune de l'indice MSCI World NR en USD. Cependant, les marchés émergents se sont inscrits en baisse d'environ 3% selon l'indice MSCI Emerging Markets NR en USD. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 1,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,6% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 0,8% pour l'Italie).

##### **Aperçu des performances**

Les fonds ont dégagé une performance absolue positive durant la période sous revue, grâce à la baisse des taux et à la bonne tenue des actions internationales. Au niveau des obligations, la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) a exercé une influence négative. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

\* Le compartiment a été liquidé le 24 septembre 2019

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA*:	LU1813277743
Numéro ISIN:	Classe AT*:	LU1813277826

Numéro de valeur:	Classe AA*:	41499344
Numéro de valeur:	Classe AT*:	41499491

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 24 septembre 2019:	Classe AA:	3,61%
	Classe CT:	3,61%

\* La classe a été clôturée le 24 septembre 2019.

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds.  
Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). En Suisse, le rendement des emprunts de la Confédération à dix ans est resté stable à -0,4%. Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en CHF a cédé 13%, contre plus de 20% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en CHF. Le marché actions suisse a mieux résisté avec un gain de 0,7% (SPI).

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la qualité plus élevée des positions par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet favorable. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0112800569
Numéro ISIN:	Classe AA USD:	LU1547438124
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0161539233
Numéro ISIN:	Classe AT USD:	LU1547438397
Numéro ISIN:	Classe BA:	LU1856096851
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999466013

Numéro de valeur:	Classe AA:	1092980
Numéro de valeur:	Classe AA USD:	35264804
Numéro de valeur:	Classe AT:	1544231
Numéro de valeur:	Classe AT USD:	35264805
Numéro de valeur:	Classe BA:	42702840
Numéro de valeur:	Classe BT:	23107250

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-3,74%
	Classe AA USD:	-0,91%
	Classe AT:	-3,74%
	Classe AT USD:	0,92%
	Classe BA:	-3,28%
	Classe BT:	-3,27%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en EUR a cédé 8,3%, contre près de 16% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en EUR.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la sous-pondération des emprunts périphériques européens par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet négatif. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0112799290
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0161534358
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999466104

Numéro de valeur:	Classe AA:	1092928
Numéro de valeur:	Classe AT:	1544242
Numéro de valeur:	Classe BT:	23107258

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-3,59%
	Classe AT:	-3,59%
	Classe BT:	-3,13%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en USD a cédé 10,4%, contre plus de 17% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en USD.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la surpondération des obligations d'entreprises et la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) ont exercé une influence négative. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU1813278048
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU1813278121

Numéro de valeur:	Classe AA:	41499676
Numéro de valeur:	Classe AT:	41499677

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-0,01%
	Classe AT:	0,00%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). En Suisse, le rendement des emprunts de la Confédération à dix ans est resté stable à -0,4%. Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en CHF a cédé 13%, contre plus de 20% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en CHF. Le marché actions suisse a mieux résisté avec un gain de 0,7% (SPI).

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la qualité plus élevée des positions par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet favorable. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0112803316
Numéro ISIN:	Classe AA USD:	LU1547438470
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0161534606
Numéro ISIN:	Classe AT USD:	LU1547438553
Numéro ISIN:	Classe BA:	LU1856096778
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999466526

Numéro de valeur:	Classe AA:	1092981
Numéro de valeur:	Classe AA USD:	35264806
Numéro de valeur:	Classe AT:	1544234
Numéro de valeur:	Classe AT USD:	35264807
Numéro de valeur:	Classe BA:	42702760
Numéro de valeur:	Classe BT:	23108348

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA	-7,16%
	Classe AA USD:	-4,44%
	Classe AT:	-7,16%
	Classe AT USD:	-4,43%
	Classe BA:	-6,64%
	Classe BT:	-6,65%



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en EUR a cédé 8,3%, contre près de 16% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en EUR.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la sous-pondération des emprunts périphériques européens par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet négatif. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0112804983
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0161533624
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999466799

Numéro de valeur:	Classe AA:	1092988
Numéro de valeur:	Classe AT:	1544240
Numéro de valeur:	Classe BT:	23108456

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-6,27%
	Classe AT:	-6,26%
	Classe BT:	-5,75%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en USD a cédé 10,4%, contre plus de 17% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en USD.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la surpondération des obligations d'entreprises et la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) ont exercé une influence négative. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU1813278394
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU1813278477
Numéro de valeur:	Classe AA:	41499701
Numéro de valeur:	Classe AT:	41499703

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-4,87%
	Classe AT:	-4,87%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). En Suisse, le rendement des emprunts de la Confédération à dix ans est resté stable à -0,4%. Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en CHF a cédé 13%, contre plus de 20% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en CHF. Le marché actions suisse a mieux résisté avec un gain de 0,7% (SPI).

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la qualité plus élevée des positions par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet favorable. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0161537534
Numéro ISIN:	Classe AA USD*:	LU1547438637
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0112806418
Numéro ISIN:	Classe AT USD*:	LU1547438710
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999467094

Numéro de valeur:	Classe AA:	1544235
Numéro de valeur:	Classe AA USD:	35264808
Numéro de valeur:	Classe AT:	1092984
Numéro de valeur:	Classe AT USD:	35264809
Numéro de valeur:	Classe BT:	23108391

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-9,94%
	Classe AA USD:	9,52%
	Classe AT:	-9,94%
	Classe AT USD:	9,95%
	Classe BT:	-9,40%

\* La classe est inactive depuis le 18/02/2020.

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds.  
Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en EUR a cédé 8,3%, contre près de 16% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en EUR.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la sous-pondération des emprunts périphériques européens par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet négatif. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0161533970
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0112799613
Numéro ISIN:	Classe DT*:	LU1990610112

Numéro de valeur:	Classe AA:	1544243
Numéro de valeur:	Classe AT:	1092929
Numéro de valeur:	Classe DT*:	47685731

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA	-9,65%
	Classe AT:	-9,65%
	Classe DT**:	-8,35%

\* La classe a été activée le 15 mai 2019

\*\* La performance des classes de parts institutionnelles est calculée sur la base de la valeur d'évaluation de l'actif net (valeur nette d'inventaire « unswung »). La performance des autres catégories est en revanche calculée sur la base de la valeur de l'actif net modifiée (valeur nette d'inventaire « swung »).

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds. Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en USD a cédé 10,4%, contre plus de 17% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en USD.

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la surpondération des obligations d'entreprises et la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) ont exercé une influence négative. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU1813278550
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU1813278634
Numéro de valeur:	Classe AA:	41499712
Numéro de valeur:	Classe AT:	41499715

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-9,34%
	Classe AT:	-9,34%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

##### Rétrospective de marché

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit. En décembre, la Chine et les Etats-Unis ont annoncé la signature d'un accord de phase 1, ce qui a considérablement détendu l'atmosphère.

La propagation étonnamment rapide du coronavirus a ensuite brutalement brouillé les cartes en Chine en janvier 2020. Mi-février, cette infection pulmonaire d'un nouveau genre a touché l'Italie, déclenchant peu de temps après des perturbations sur les marchés financiers. Les mesures prises par les gouvernements pour enrayer la propagation incontrôlée ont entraîné la mise à l'arrêt de pans entiers de l'économie et considérablement limité la vie sociale à travers le monde. En parallèle, les gouvernements et les banques centrales ont tout mis en œuvre pour amortir le choc et éviter une vague de faillites et de licenciements. Ce qui a été perçu comme un problème insignifiant dans une province chinoise est devenu le plus grand défi que le monde ait dû affronter depuis la fin de la Seconde Guerre mondiale.

##### Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds

Les marchés ont lourdement pâti des développements survenus lors des dernières semaines de l'exercice, au cours desquelles la propagation du coronavirus a déclenché des ventes massives et une forte incertitude sur les marchés financiers. Les marchés actions ont subi la correction la plus brutale de leur histoire, les taux d'intérêt ont chuté et les spreads de crédit des obligations d'entreprises se sont sensiblement élargis. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 0,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,5% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 1,5% pour l'Italie). En Suisse, le rendement des emprunts de la Confédération à dix ans est resté stable à -0,4%. Au niveau des actions, l'indice MSCI World NR en CHF a cédé 13%, contre plus de 20% pour l'indice MSCI Emerging Markets NR en CHF. Le marché actions suisse a mieux résisté avec un gain de 0,7% (SPI).

##### Aperçu des performances

Les fonds ont dégagé une performance absolue négative sur les 12 derniers mois. Au niveau des obligations, la qualité plus élevée des positions par rapport à l'indice de référence (Customized Benchmark) a eu un effet favorable. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA:	LU0161534861
Numéro ISIN:	Classe AA EUR:	LU1547439015
Numéro ISIN:	Classe AA USD:	LU1547438801
Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0112806921
Numéro ISIN:	Classe AT EUR:	LU1547439106
Numéro ISIN:	Classe AT USD*:	LU1547438983
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999467250
Numéro ISIN:	Classe DT:	LU0899940711
Numéro ISIN:	Classe NT*:	LU1950833639

Numéro de valeur:	Classe AA:	1544237
Numéro de valeur:	Classe AA EUR:	35264812
Numéro de valeur:	Classe AA USD:	35264810
Numéro de valeur:	Classe AT:	1092986
Numéro de valeur:	Classe AT EUR:	35264813
Numéro de valeur:	Classe AT USD*:	35264811
Numéro de valeur:	Classe BT:	23108487
Numéro de valeur:	Classe DT:	20858339
Numéro de valeur:	Classe NT:	46359999

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 31 mars 2020:	Classe AA:	-12,98%
	Classe AA EUR:	-8,33%
	Classe AA USD:	-10,44%
	Classe AT:	-12,98%
	Classe AT EUR:	-8,33%
	Classe AT USD:	10,53%
	Classe BT:	-12,41%
	Classe DT**:	-12,10%
	Classe NT**:	-11,35%

\* La classe est inactive depuis le 18 février 2020

\*\* La performance des classes de parts institutionnelles est calculée sur la base de la valeur d'évaluation de l'actif net (valeur nette d'inventaire « unswung »). La performance des autres catégories est en revanche calculée sur la base de la valeur de l'actif net modifiée (valeur nette d'inventaire « swung »).

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds. Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### **Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)\***

##### **Rétrospective de marché**

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit.

##### **Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds**

L'évolution des marchés a été dictée en grande partie par la politique accommodante des banques centrales. Tels que mesurés par l'indice MSCI World NR en EUR, les marchés actions ont progressé d'environ 6,8%. Les marchés émergents ont suivi une évolution moins réjouissante avec une baisse d'environ 1% selon l'indice MSCI Emerging Markets NR en EUR. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 1,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,6% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 0,8% pour l'Italie).

##### **Aperçu des performances**

Les fonds ont dégagé une performance absolue positive durant la période sous revue, grâce à la baisse des taux et à la bonne tenue des actions internationales. Au niveau des obligations, la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) a exercé une influence négative. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits..

\* Le compartiment a été liquidé le 24 septembre 2019

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA*:	LU1775789248
Numéro ISIN:	Classe AT*:	LU1775789321
Numéro de valeur:	Classe AA*:	40488076
Numéro de valeur:	Classe AT*:	40488080

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 24 septembre 2019:	Classe AA:	2,90%
	Classe AT:	2,90%

\* La classe a été clôturée le 24 septembre 2019.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

#### **Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)\***

##### **Rétrospective de marché**

L'année écoulée a d'abord été marquée par le durcissement du conflit commercial sino-américain, qui a entraîné un fléchissement des indicateurs avancés. En particulier, la situation du secteur manufacturier, qui a subi de plein fouet les droits de douane, s'est dégradée comme jamais depuis la fin 2012. Le secteur des services a mieux résisté, même si ses perspectives de croissance se sont assombries. Il a subi une pression croissante à l'automne, surtout en Europe. Les banques centrales sont une fois de plus venues à la rescousse des marchés, annonçant une baisse des taux (Fed) et d'autres mesures d'assouplissement (BCE). Le dynamisme de l'emploi aux Etats-Unis, mais aussi en Europe, a continué de soutenir la consommation. Au niveau géopolitique, les risques ont diminué avec la perspective d'un accord (partiel) dans le conflit commercial sino-américain fin décembre 2019. Un certain apaisement s'est également profilé sur le front du Brexit.

##### **Rétrospective des catégories pertinentes pour le fonds**

L'évolution des marchés a été dictée en grande partie par la politique accommodante des banques centrales. Les marchés actions ont progressé d'environ 4,6% à l'aune de l'indice MSCI World NR en USD. Cependant, les marchés émergents se sont inscrits en baisse d'environ 3% selon l'indice MSCI Emerging Markets NR en USD. Par rapport à leurs emprunts d'Etat à dix ans respectifs, les rendements en USD ont chuté de 2,4% à 1,7%, tandis que ceux en EUR baissaient de -0,1% à -0,6% pour l'Allemagne (et de 2,5% à 0,8% pour l'Italie).

##### **Aperçu des performances**

Les fonds ont dégagé une performance absolue positive durant la période sous revue, grâce à la baisse des taux et à la bonne tenue des actions internationales. Au niveau des obligations, la durée légèrement plus courte que celle de l'indice de référence (Customized Benchmark) a exercé une influence négative. Concernant la stratégie quantitative en actions internationales, la surpondération des titres « value » par rapport à l'indice de référence a fourni une contribution négative. En revanche, la sélection au sein des actions émergentes ainsi que l'allocation sectorielle tactique ont porté leurs fruits.

\* Le compartiment a été liquidé le 24 septembre 2019

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport d'activité (suite)

Numéro ISIN:	Classe AA*:	LU1813278808
Numéro ISIN:	Classe AT*:	LU1813278980
Numéro de valeur:	Classe AA*:	41499719
Numéro de valeur:	Classe AT*:	41499721

Performance du compartiment 1 <sup>er</sup> avril 2019 - 24 septembre 2019:	Classe AA:	2,85%
	Classe AT:	2,85%

\* La classe a été clôturée le 24 septembre 2019.

La performance historique ne donne pas d'indication sur la performance actuelle ou future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et des frais perçus lors de l'émission et du rachat de parts du fonds. Les informations et chiffres de ce rapport sont donnés à titre historique et ne sont pas indicatifs de résultats futurs.



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Etat du patrimoine au 31 mars 2020

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)
	Note	CHF	EUR	CHF	EUR
<b>ACTIFS</b>					
Etat du portefeuille-titres, options comprises (options acquises) à la valeur de marché					
	(2)	116.345.286	324.546.527	105.764.936	15.957.188
Avoirs bancaires		4.271.183	19.571.821	3.936.498	2.759.849
A recevoir sur ventes de titres		138.486	390.654	0	0
A recevoir sur émissions de parts		41.417	142.011	17.003	9.852
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres		475.677	1.701.028	505.863	118.024
Plus-values non réalisées sur changes à terme	(5)	0	68.538	175.405	0
Plus-values non réalisées sur futures	(4)	0	0	0	46.339
Autres actifs nets		0	379.067	0	37.483
A recevoir sur spot currency		52.513.802	92.507.153	39.053.814	844.138
<b>TOTAL DE L'ACTIF</b>		<b>173.785.851</b>	<b>439.306.799</b>	<b>149.453.519</b>	<b>19.772.873</b>
<b>EXIGIBLE</b>					
Découvert bancaire		0	0	190.511	119.995
A payer sur achats de titres		315.113	1.072.498	0	0
A payer sur rachats de parts		196.267	65.413	86.170	0
Moins-values non réalisées sur contrats de change à terme	(5)	381.782	0	0	11.135
Moins-values non réalisées sur futures	(4)	0	0	95.312	0
Intérêts bancaires et frais à payer		52.518.572	93.183.412	39.210.526	862.660
<b>TOTAL DE L'EXIGIBLE</b>		<b>53.411.734</b>	<b>94.321.323</b>	<b>39.582.519</b>	<b>993.790</b>
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>120.374.117</b>	<b>344.985.476</b>	<b>109.871.000</b>	<b>18.779.083</b>
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>					
Classe AA		168,52	110,16	96,89	97,67
Classe AA EUR		-	-	-	-
Classe AA USD		-	-	-	-
Classe AT		186,57	125,64	135,88	98,96
Classe AT EUR		-	-	-	-
Classe AT USD		-	-	-	-
Classe BA		-	-	-	-
Classe BT		105,93	-	98,32	-
Classe DA		-	97,41	-	-
Classe DT		-	-	-	-
Classe NT		-	-	-	-
<b>Nombre de parts en circulation</b>					
Classe AA		314.253	2.856.419	832.105	95.415
Classe AA EUR		-	-	-	-
Classe AA USD		-	-	-	-
Classe AT		341.129	209.142	208.514	95.598
Classe AT EUR		-	-	-	-
Classe AT USD		-	-	-	-
Classe BA		-	-	-	-
Classe BT		35.608	-	9.264	-
Classe DA		-	41.587	-	-
Classe DT		-	-	-	-
Classe NT		-	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Etat du patrimoine au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)
	Note	CHF	EUR	USD	CHF
<b>ACTIFS</b>					
Etat du portefeuille-titres, options comprises (options acquises) à la valeur de marché					
	(2)	731.128.043	153.240.957	16.042.137	694.807.972
Avoirs bancaires		50.653.277	28.133.656	1.249.087	53.112.172
A recevoir sur ventes de titres		0	0	0	0
A recevoir sur émissions de parts		8.081	22.259	0	28.289
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres		4.085.930	778.306	77.536	2.616.671
Plus-values non réalisées sur changes à terme	(5)	60.763	380.348	15.818	0
Plus-values non réalisées sur futures	(4)	1.962.262	413.062	94.166	1.538.842
Autres actifs nets		0	363.100	0	0
A recevoir sur spot currency		187.732.095	31.117.131	759.455	58.162.358
<b>TOTAL DE L'ACTIF</b>		<b>975.630.451</b>	<b>214.448.819</b>	<b>18.238.199</b>	<b>810.266.304</b>
<b>EXIGIBLE</b>					
Découvert bancaire		3.173.432	1.242.622	141.239	4.053.306
A payer sur achats de titres		0	0	0	0
A payer sur rachats de parts		235.710	8.869	0	143.241
Moins-values non réalisées sur contrats de change à terme	(5)	0	0	0	994.598
Moins-values non réalisées sur futures	(4)	0	0	0	0
Intérêts bancaires et frais à payer		189.600.842	31.390.655	777.906	60.496.166
<b>TOTAL DE L'EXIGIBLE</b>		<b>193.009.984</b>	<b>32.642.146</b>	<b>919.145</b>	<b>65.687.311</b>
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>782.620.467</b>	<b>181.806.673</b>	<b>17.319.054</b>	<b>744.578.993</b>
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>					
Classe AA		134,04	112,60	100,46	166,62
Classe AA EUR		-	-	-	-
Classe AA USD		102,20	-	-	102,33
Classe AT		175,39	162,70	101,05	206,57
Classe AT EUR		-	-	-	-
Classe AT USD		104,59	-	-	104,10
Classe BA		96,30	-	-	92,46
Classe BT		102,56	101,83	-	107,46
Classe DA		-	-	-	-
Classe DT		-	-	-	-
Classe NT		-	-	-	-
<b>Nombre de parts en circulation</b>					
Classe AA		3.984.724	1.141.611	82.286	2.840.253
Classe AA EUR		-	-	-	-
Classe AA USD		380	-	-	433
Classe AT		1.364.021	318.935	89.586	1.250.216
Classe AT EUR		-	-	-	-
Classe AT USD		835	-	-	4.864
Classe BA		6.339	-	-	10.553
Classe BT		83.150	13.482	-	107.623
Classe DA		-	-	-	-
Classe DT		-	-	-	-
Classe NT		-	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Etat du patrimoine au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)
	Note	EUR	USD	CHF	EUR
<b>ACTIFS</b>					
Etat du portefeuille-titres, options comprises (options acquises) à la valeur de marché					
	(2)	132.740.000	12.890.927	173.029.074	38.898.626
Avoirs bancaires		17.246.014	1.326.493	15.761.272	5.094.151
A recevoir sur ventes de titres		0	0	0	0
A recevoir sur émissions de parts		6.187	0	59.159	93
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres		462.648	43.288	381.646	104.507
Plus-values non réalisées sur changes à terme	(5)	77.967	29.912	0	0
Plus-values non réalisées sur futures	(4)	520.548	113.719	0	219.592
Autres actifs nets		300.136	0	0	0
A recevoir sur spot currency		6.699.334	749.055	14.542.807	1.983.705
<b>TOTAL DE L'ACTIF</b>		<b>158.052.834</b>	<b>15.153.394</b>	<b>203.773.958</b>	<b>46.300.674</b>
<b>EXIGIBLE</b>					
Découvert bancaire		870.563	153.967	1.271.684	300.764
A payer sur achats de titres		0	0	0	0
A payer sur rachats de parts		15.378	0	34.847	4.307
Moins-values non réalisées sur contrats de change à terme	(5)	0	0	149.320	17.783
Moins-values non réalisées sur futures	(4)	0	0	88.593	0
Intérêts bancaires et frais à payer		6.907.285	766.228	15.113.981	2.087.864
<b>TOTAL DE L'EXIGIBLE</b>		<b>7.793.226</b>	<b>920.195</b>	<b>16.658.425</b>	<b>2.410.718</b>
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>150.259.608</b>	<b>14.233.199</b>	<b>187.115.533</b>	<b>43.889.956</b>
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>					
Classe AA		124,70	93,99	224,61	123,77
Classe AA EUR		-	-	-	-
Classe AA USD		-	-	-	-
Classe AT		164,74	94,22	261,70	154,34
Classe AT EUR		-	-	-	-
Classe AT USD		-	-	-	-
Classe BA		-	-	-	-
Classe BT		107,89	-	100,30	-
Classe DA		-	-	-	-
Classe DT		-	-	-	91,51
Classe NT		-	-	-	-
<b>Nombre de parts en circulation</b>					
Classe AA		835.856	69.408	106.648	45.298
Classe AA EUR		-	-	-	-
Classe AA USD		-	-	-	-
Classe AT		263.826	81.824	613.954	65.427
Classe AT EUR		-	-	-	-
Classe AT USD		-	-	-	-
Classe BA		-	-	-	-
Classe BT		23.761	-	24.838	-
Classe DA		-	-	-	-
Classe DT		-	-	-	308.010
Classe NT		-	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Etat du patrimoine au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	Consolidé
	Note	USD	CHF	CHF
<b>ACTIFS</b>				
Etat du portefeuille-titres, options comprises (options acquises) à la valeur de marché				
	(2)	11.482.895	143.213.301	2.709.793.925
Avoirs bancaires		999.507	13.030.146	221.517.210
A recevoir sur ventes de titres		0	0	553.222
A recevoir sur émissions de parts		0	133.839	479.310
Revenus à recevoir sur portefeuille-titres		19.147	282.104	11.842.909
Plus-values non réalisées sur changes à terme	(5)	13.790	72.011	925.099
Plus-values non réalisées sur futures	(4)	51.534	133.513	5.159.106
Autres actifs nets		0	0	1.146.349
A recevoir sur spot currency		537.152	20.961.417	516.305.153
<b>TOTAL DE L'ACTIF</b>		<b>13.104.025</b>	<b>177.826.331</b>	<b>3.467.722.283</b>
<b>EXIGIBLE</b>				
Découvert bancaire		93.443	1.045.354	12.800.474
A payer sur achats de titres		0	0	1.453.726
A payer sur rachats de parts		0	11.935	807.929
Moins-values non réalisées sur contrats de change à terme	(5)	0	0	1.556.400
Moins-values non réalisées sur futures	(4)	0	0	183.905
Intérêts bancaires et frais à payer		554.451	21.501.739	523.191.241
<b>TOTAL DE L'EXIGIBLE</b>		<b>647.894</b>	<b>22.559.028</b>	<b>539.993.675</b>
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>12.456.131</b>	<b>155.267.303</b>	<b>2.927.728.608</b>
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>				
Classe AA		87,99	278,64	
Classe AA EUR		-	100,89	
Classe AA USD		-	103,63	
Classe AT		87,99	306,02	
Classe AT EUR		-	101,75	
Classe AT USD		-	-	
Classe BA		-	-	
Classe BT		-	106,20	
Classe DA		-	-	
Classe DT		-	117,75	
Classe NT		-	88,34	
<b>Nombre de parts en circulation</b>				
Classe AA		71.302	60.334	
Classe AA EUR		-	160	
Classe AA USD		-	85	
Classe AT		70.257	427.318	
Classe AT EUR		-	940	
Classe AT USD		-	-	
Classe BA		-	-	
Classe BT		-	18.204	
Classe DA		-	-	
Classe DT		-	2.327	
Classe NT		-	60.600	

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Etat des opérations et des autres variations de l'actif net  
du 1 avril 2019 au 31 mars 2020

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)
	Note	CHF	EUR	CHF	EUR
<b>ACTIF NET AU DEBUT DE L'EXERCICE</b>		<b>138.385.973</b>	<b>214.372.935</b>	<b>123.266.472</b>	<b>18.705.680</b>
<b>REVENUS</b>					
Dividendes, nets		732.037	1.458.906	280.421	56.465
Intérêts sur obligations et autres titres, nets		1.422.085	3.233.842	1.745.478	293.129
Intérêts bancaires		27.912	21.825	42.568	8.435
Commissions reçues		0	0	7.870	806
Autres revenus		680	390	59.201	5.652
<b>TOTAL DES REVENUS</b>		<b>2.182.714</b>	<b>4.714.963</b>	<b>2.135.538</b>	<b>364.487</b>
<b>CHARGES</b>					
Frais sur transactions	(10)	10.104	9.772	19.316	9.851
Frais d'administration centrale	(7)	1.973.157	4.181.896	1.083.065	175.716
Taxe d'abonnement	(6)	68.643	141.463	59.450	9.690
Intérêts bancaires payés		20.758	121.068	32.284	12.222
Autres charges		0	0	0	19
<b>TOTAL DES CHARGES</b>		<b>2.072.662</b>	<b>4.454.199</b>	<b>1.194.115</b>	<b>207.498</b>
<b>COMPENSATION DES REVENUS</b>		<b>(4.337)</b>	<b>214.906</b>	<b>(37.105)</b>	<b>4.190</b>
<b>REVENUS NETS DES</b>					
<b>INVESTISSEMENTS</b>		<b>105.715</b>	<b>475.670</b>	<b>904.318</b>	<b>161.179</b>
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres		2.479.684	3.353.503	(654.156)	(53.766)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'options		0	0	(47.361)	(7.223)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur changes à terme		1.181.211	(2.270.351)	868.537	(37.998)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur futures		0	0	426.602	(59.894)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur devises		(258.136)	(1.983.252)	(370.504)	6.865
<b>BENEFICE/(PERTE) NET(TE)</b>		<b>3.508.474</b>	<b>(424.430)</b>	<b>1.127.436</b>	<b>9.163</b>
<b>REALISE(E)</b>					
<b>Variation nette de la plus-value</b>					
<b>/(moins-value) non réalisée</b>					
- sur portefeuille-titres		(12.734.273)	(24.314.110)	(5.092.186)	(655.226)
- sur futures		0	0	(171.990)	38.900
- sur changes à terme		(605.558)	859.509	295.118	(9.461)
<b>AUGMENTATION/DIMINUTION NETTE</b>		<b>(9.831.357)</b>	<b>(23.879.031)</b>	<b>(3.841.622)</b>	<b>(616.624)</b>
<b>DE L'ACTIF NET</b>					
Emissions	(2)	10.620.041	179.026.915	15.711.712	1.206.551
Rachats	(2)	(18.502.184)	(23.337.058)	(23.931.779)	(388.107)
Dividendes distribués		(302.693)	(983.379)	(1.370.888)	(124.227)
Compensation des revenus		4.337	(214.906)	37.105	(4.190)
Ecart de réévaluation	(2)	0	0	0	0
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>120.374.117</b>	<b>344.985.476</b>	<b>109.871.000</b>	<b>18.779.083</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Etat des opérations et des autres variations de l'actif net  
du 1 avril 2019 au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)
	Note	USD	CHF	EUR	USD
<b>ACTIF NET AU DEBUT DE L'EXERCICE</b>		<b>23.819.664</b>	<b>901.857.980</b>	<b>159.635.789</b>	<b>12.299.149</b>
<b>REVENUS</b>					
Dividendes, nets		40.661	3.520.236	1.090.972	69.425
Intérêts sur obligations et autres titres, nets		231.734	13.021.331	2.298.605	261.581
Intérêts bancaires		23.099	310.301	78.036	17.024
Commissions reçues		641	58.395	12.205	0
Autres revenus		3.436	733.023	126.916	3.345
<b>TOTAL DES REVENUS</b>		<b>299.571</b>	<b>17.643.286</b>	<b>3.606.734</b>	<b>351.375</b>
<b>CHARGES</b>					
Frais sur transactions	(10)	7.100	63.615	24.311	11.123
Frais d'administration centrale	(7)	102.548	10.458.826	2.146.168	193.344
Taxe d'abonnement	(6)	3.191	426.993	89.544	8.451
Intérêts bancaires payés		936	133.158	72.503	2.235
Autres charges		0	0	62	0
<b>TOTAL DES CHARGES</b>		<b>113.775</b>	<b>11.082.592</b>	<b>2.332.588</b>	<b>215.153</b>
<b>COMPENSATION DES REVENUS</b>		<b>0</b>	<b>(371.855)</b>	<b>148.381</b>	<b>22.531</b>
<b>REVENUS NETS DES INVESTISSEMENTS</b>		<b>185.796</b>	<b>6.188.839</b>	<b>1.422.527</b>	<b>158.753</b>
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres		1.079.074	1.318.942	(398.891)	(3.635)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'options		0	(347.311)	(74.040)	(16.113)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur changes à terme		(25.952)	(488.268)	(1.462.048)	26.054
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur futures		31.807	3.310.518	(240.561)	5.721
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur devises		13.542	(1.812.777)	(1.322.577)	(26.963)
<b>BENEFICE/(PERTE) NET(TE) REALISE(E)</b>		<b>1.284.267</b>	<b>8.169.943</b>	<b>(2.075.590)</b>	<b>143.817</b>
<b>Variation nette de la plus-value /(moins-value) non réalisée</b>					
- sur portefeuille-titres		(386.370)	(39.839.171)	(7.139.418)	(349.752)
- sur futures		(13.507)	1.418.141	328.957	90.325
- sur changes à terme		(1.570)	2.434.922	1.038.123	12.726
<b>AUGMENTATION/DIMINUTION NETTE DE L'ACTIF NET</b>		<b>882.820</b>	<b>(27.816.165)</b>	<b>(7.847.928)</b>	<b>(102.884)</b>
Emissions	(2)	795.036	67.501.071	53.153.219	9.304.068
Rachats	(2)	(25.387.914)	(151.385.607)	(22.098.605)	(4.123.809)
Dividendes distribués		(109.606)	(7.908.667)	(887.421)	(34.939)
Compensation des revenus		0	371.855	(148.381)	(22.531)
Ecart de réévaluation	(2)	0	0	0	0
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>0</b>	<b>782.620.467</b>	<b>181.806.673</b>	<b>17.319.054</b>

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Etat des opérations et des autres variations de l'actif net  
du 1 avril 2019 au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)
	Note	CHF	EUR	USD	CHF
<b>ACTIF NET AU DEBUT DE L'EXERCICE</b>		<b>861.464.326</b>	<b>135.296.762</b>	<b>13.635.115</b>	<b>234.592.541</b>
<b>REVENUS</b>					
Dividendes, nets		6.792.528	1.502.143	105.275	2.790.692
Intérêts sur obligations et autres titres, nets		7.071.740	1.247.334	162.593	928.442
Intérêts bancaires		336.446	92.154	15.668	87.040
Commissions reçues		48.735	8.812	0	4.811
Autres revenus		1.444.464	150.087	7.473	477.090
<b>TOTAL DES REVENUS</b>		<b>15.693.913</b>	<b>3.000.530</b>	<b>291.009</b>	<b>4.288.075</b>
<b>CHARGES</b>					
Frais sur transactions	(10)	62.709	23.412	10.325	32.258
Frais d'administration centrale	(7)	11.463.063	2.042.729	202.186	3.386.964
Taxe d'abonnement	(6)	426.573	75.922	7.444	109.776
Intérêts bancaires payés		167.513	51.830	843	25.859
Autres charges		0	0	0	0
<b>TOTAL DES CHARGES</b>		<b>12.119.858</b>	<b>2.193.893</b>	<b>220.798</b>	<b>3.554.857</b>
<b>COMPENSATION DES REVENUS</b>		<b>(167.016)</b>	<b>130.849</b>	<b>2.758</b>	<b>(65.613)</b>
<b>REVENUS NETS DES</b>					
<b>INVESTISSEMENTS</b>		<b>3.407.039</b>	<b>937.486</b>	<b>72.969</b>	<b>667.605</b>
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres		(5.841.487)	490.193	(341.081)	(4.185.805)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'options		(347.311)	(63.204)	(12.085)	(92.748)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur changes à terme		149.815	(471.305)	7.429	(563.478)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur futures		2.535.571	(432.173)	(36.052)	1.555.027
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur devises		(1.409.731)	(316.620)	3.916	(71.981)
<b>BENEFICE/(PERTE) NET(TE)</b>		<b>(1.506.104)</b>	<b>144.377</b>	<b>(304.904)</b>	<b>(2.691.380)</b>
<b>REALISE(E)</b>					
<b>Variation nette de la plus-value</b>					
<b>/(moins-value) non réalisée</b>					
- sur portefeuille-titres		(55.739.117)	(12.294.594)	(628.481)	(17.373.861)
- sur futures		1.651.000	476.120	110.571	(126.887)
- sur changes à terme		(1.043.315)	178.159	27.129	(217.623)
<b>AUGMENTATION/DIMINUTION NETTE</b>		<b>(56.637.536)</b>	<b>(11.495.938)</b>	<b>(795.685)</b>	<b>(20.409.751)</b>
<b>DE L'ACTIF NET</b>					
Emissions	(2)	90.394.421	46.961.270	1.857.604	18.074.945
Rachats	(2)	(146.537.289)	(19.757.693)	(444.965)	(45.083.994)
Dividendes distribués		(4.271.945)	(613.944)	(16.112)	(123.821)
Compensation des revenus		167.016	(130.849)	(2.758)	65.613
Ecart de réévaluation	(2)	0	0	0	0
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>744.578.993</b>	<b>150.259.608</b>	<b>14.233.199</b>	<b>187.115.533</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Etat des opérations et des autres variations de l'actif net  
du 1 avril 2019 au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)*
	Note	EUR	USD	CHF	EUR
<b>ACTIF NET AU DEBUT DE L'EXERCICE</b>		<b>16.912.459</b>	<b>10.737.267</b>	<b>201.082.330</b>	<b>8.824.266</b>
<b>REVENUS</b>					
Dividendes, nets		474.525	117.221	2.818.762	96.488
Intérêts sur obligations et autres titres, nets		209.601	64.015	158.103	4.193
Intérêts bancaires		22.246	19.078	100.893	5.019
Commissions reçues		477	0	2.917	195
Autres revenus		20.462	8.864	456.764	13.230
<b>TOTAL DES REVENUS</b>		<b>727.311</b>	<b>209.178</b>	<b>3.537.439</b>	<b>119.125</b>
<b>CHARGES</b>					
Frais sur transactions	(10)	18.664	10.226	26.515	8.185
Frais d'administration centrale	(7)	451.772	197.937	3.101.468	67.287
Taxe d'abonnement	(6)	11.712	6.533	91.151	1.138
Intérêts bancaires payés		13.213	571	79.435	1.339
Autres charges		400	0	0	0
<b>TOTAL DES CHARGES</b>		<b>495.761</b>	<b>215.267</b>	<b>3.298.569</b>	<b>77.949</b>
<b>COMPENSATION DES REVENUS</b>		<b>80.979</b>	<b>5.425</b>	<b>(24.256)</b>	<b>0</b>
<b>REVENUS NETS DES INVESTISSEMENTS</b>		<b>312.529</b>	<b>(664)</b>	<b>214.614</b>	<b>41.176</b>
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres		(596.412)	(457.066)	(5.945.974)	512.646
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'options		(19.864)	(12.085)	(78.934)	0
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur changes à terme		(90.854)	(9.319)	(486.492)	(14.468)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur futures		246.714	78.831	698.005	23.471
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur devises		59.957	(9.234)	(55.343)	10.543
<b>BENEFICE/(PERTE) NET(TE) REALISE(E)</b>		<b>(87.930)</b>	<b>(409.537)</b>	<b>(5.654.124)</b>	<b>573.368</b>
<b>Variation nette de la plus-value /(moins-value) non réalisée</b>					
- sur portefeuille-titres		(4.487.364)	(1.079.365)	(16.915.618)	(316.642)
- sur futures		206.183	39.527	120.645	76
- sur changes à terme		(21.303)	9.013	99.830	79
<b>AUGMENTATION/DIMINUTION NETTE DE L'ACTIF NET</b>		<b>(4.390.414)</b>	<b>(1.440.362)</b>	<b>(22.349.267)</b>	<b>256.881</b>
Emissions	(2)	35.014.927	4.118.741	10.252.074	36.612
Rachats	(2)	(3.530.807)	(954.090)	(33.636.964)	(9.088.563)
Dividendes distribués		(35.230)	0	(105.126)	(29.196)
Compensation des revenus		(80.979)	(5.425)	24.256	0
Ecart de réévaluation	(2)	0	0	0	0
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>43.889.956</b>	<b>12.456.131</b>	<b>155.267.303</b>	<b>0</b>

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Etat des opérations et des autres variations de l'actif net  
du 1 avril 2019 au 31 mars 2020 (suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)*	Consolidé
	Note	USD	CHF
<b>ACTIF NET AU DEBUT DE L'EXERCICE</b>		<b>11.387.400</b>	<b>3.151.459.880</b>
<b>REVENUS</b>			
Dividendes, nets		77.121	22.299.051
Intérêts sur obligations et autres titres, nets		9.293	32.788.625
Intérêts bancaires		9.530	1.228.573
Commissions reçues		0	147.230
Autres revenus		12.370	3.541.822
<b>TOTAL DES REVENUS</b>		<b>108.314</b>	<b>60.005.301</b>
<b>CHARGES</b>			
Frais sur transactions	(10)	7.237	359.037
Frais d'administration centrale	(7)	88.399	41.849.920
Taxe d'abonnement	(6)	1.506	1.558.609
Intérêts bancaires payés		850	753.217
Autres charges		0	510
<b>TOTAL DES CHARGES</b>		<b>97.992</b>	<b>44.521.293</b>
<b>COMPENSATION DES REVENUS</b>		<b>0</b>	<b>(25.448)</b>
<b>REVENUS NETS DES INVESTISSEMENTS</b>		<b>10.322</b>	<b>15.458.560</b>
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres		319.565	(8.740.155)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur ventes d'options		0	(1.127.103)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur changes à terme		(17.876)	(3.972.698)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur futures		15.054	8.127.038
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur devises		13.119	(7.747.529)
<b>BENEFICE/(PERTE) NET(TE) REALISE(E)</b>		<b>340.184</b>	<b>1.998.113</b>
<b>Variation nette de la plus-value /(moins-value) non réalisée</b>			
- sur portefeuille-titres		(4.464)	(202.303.946)
- sur futures		(6.638)	4.219.015
- sur changes à terme		(3.503)	3.176.921
<b>AUGMENTATION/DIMINUTION NETTE DE L'ACTIF NET</b>		<b>325.579</b>	<b>(192.909.897)</b>
Emissions	(2)	331.211	563.270.822
Rachats	(2)	(12.044.190)	(543.660.420)
Dividendes distribués		0	(17.076.782)
Compensation des revenus		0	25.448
Ecart de réévaluation	(2)	0	(33.380.443)
<b>ACTIF NET A LA FIN DE L'EXERCICE</b>		<b>0</b>	<b>2.927.728.608</b>

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)
<b>Classe AA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	321.541	1.653.509	877.493
	Nombre de parts émises	26.847	1.368.507	106.725
	Nombre de parts rachetées	(34.135)	(165.597)	(152.113)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	314.253	2.856.419	832.105
<b>Classe BA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe BT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	27.689	0	9.749
	Nombre de parts émises	10.586	0	2.586
	Nombre de parts rachetées	(2.667)	0	(3.071)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	35.608	0	9.264
<b>Classe DA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	9.096	0
	Nombre de parts émises	0	36.410	0
	Nombre de parts rachetées	0	(3.919)	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	41.587	0
<b>Classe DT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe NT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	100
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(100)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	377.790	163.707	233.236
	Nombre de parts émises	20.931	72.402	31.022
	Nombre de parts rachetées	(57.592)	(26.967)	(55.744)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	341.129	209.142	208.514
<b>Classe AT EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	495
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(495)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AT USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation  
pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020  
(suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)
<b>Classe AA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	91.922	112.070	4.350.891
	Nombre de parts émises	7.021	3.305	308.920
	Nombre de parts rachetées	(3.528)	(115.375)	(675.087)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	95.415	0	3.984.724
<b>Classe BA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	8.126
	Nombre de parts émises	0	0	955
	Nombre de parts rachetées	0	0	(2.742)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	6.339
<b>Classe BT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	97.412
	Nombre de parts émises	0	0	10.699
	Nombre de parts rachetées	0	0	(24.961)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	83.150
<b>Classe DA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe DT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe NT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	1.987
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(1.607)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	380
<b>Classe AT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	91.649	121.147	1.518.338
	Nombre de parts émises	4.227	4.425	119.811
	Nombre de parts rachetées	(278)	(125.572)	(274.128)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	95.598	0	1.364.021
<b>Classe AT EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AT USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	935
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(100)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	835

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation  
pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020  
(suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)
<b>Classe AA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	860.827	58.104	2.985.524
	Nombre de parts émises	389.962	55.702	294.886
	Nombre de parts rachetées	(109.178)	(31.520)	(440.157)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	1.141.611	82.286	2.840.253
<b>Classe BA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	9.787
	Nombre de parts émises	0	0	1.514
	Nombre de parts rachetées	0	0	(748)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	10.553
<b>Classe BT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	15.629	0	95.853
	Nombre de parts émises	1.697	0	27.708
	Nombre de parts rachetées	(3.844)	0	(15.938)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	13.482	0	107.623
<b>Classe DA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe DT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe NT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	965
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(532)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	433
<b>Classe AT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	335.740	63.605	1.388.654
	Nombre de parts émises	33.585	32.843	141.927
	Nombre de parts rachetées	(50.390)	(6.862)	(280.365)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	318.935	89.586	1.250.216
<b>Classe AT EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AT USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	2.949
	Nombre de parts émises	0	0	2.360
	Nombre de parts rachetées	0	0	(445)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	4.864

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation  
pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020  
(suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)
<b>Classe AA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	619.076	59.503	90.343
	Nombre de parts émises	292.711	11.884	29.687
	Nombre de parts rachetées	(75.931)	(1.979)	(13.382)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	835.856	69.408	106.648
<b>Classe BA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe BT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	14.681	0	27.441
	Nombre de parts émises	11.060	0	4.293
	Nombre de parts rachetées	(1.980)	0	(6.896)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	23.761	0	24.838
<b>Classe DA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe DT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe NT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AA USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	100
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(100)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	288.536	78.164	718.843
	Nombre de parts émises	27.740	6.150	33.557
	Nombre de parts rachetées	(52.450)	(2.490)	(138.446)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	263.826	81.824	613.954
<b>Classe AT EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe AT USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	100
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(100)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation  
pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020  
(suite)

		Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)
<b>Classe AA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	31.821	50.340	58.103
	Nombre de parts émises	18.628	21.202	10.631
	Nombre de parts rachetées	(5.151)	(240)	(8.400)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	45.298	71.302	60.334
<b>Classe BA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe BT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	21.455
	Nombre de parts émises	0	0	1.856
	Nombre de parts rachetées	0	0	(5.107)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	18.204
<b>Classe DA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	0
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0
<b>Classe DT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	2.471
	Nombre de parts émises	308.010	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(144)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	308.010	0	2.327
<b>Classe NT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	60.600
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	60.600
<b>Classe AA EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	430
	Nombre de parts émises	0	0	160
	Nombre de parts rachetées	0	0	(430)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	160
<b>Classe AA USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	185
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(100)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	85
<b>Classe AT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	73.303	60.300	491.304
	Nombre de parts émises	7.801	20.303	18.736
	Nombre de parts rachetées	(15.677)	(10.346)	(82.722)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	65.427	70.257	427.318
<b>Classe AT EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	4.260
	Nombre de parts émises	0	0	220
	Nombre de parts rachetées	0	0	(3.540)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	940
<b>Classe AT USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0	100
	Nombre de parts émises	0	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0	(100)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0	0

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation  
pour l'exercice du 1 avril 2019 au 31 mars 2020  
(suite)

		<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)*</b>	<b>Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)*</b>
<b>Classe AA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	44.651	67.220
	Nombre de parts émises	206	3.400
	Nombre de parts rachetées	(44.857)	(70.620)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe BA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe BT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe DA</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe DT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe NT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe AA EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe AA USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe AT</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	43.494	52.154
	Nombre de parts émises	63	0
	Nombre de parts rachetées	(43.557)	(52.154)
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe AT EUR</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0
<b>Classe AT USD</b>	Nombre de parts en circulation au début de l'exercice	0	0
	Nombre de parts émises	0	0
	Nombre de parts rachetées	0	0
	Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	0	0

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)
	CHF	EUR	CHF
<b>ACTIF NET</b>			
31 mars 2020	120.374.117	344.985.476	109.871.000
31 mars 2019	138.385.973	214.372.935	123.266.472
31 mars 2018	153.732.045	142.430.744	182.490.319
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>			
<b>31 mars 2020</b>			
Classe AA	168,52	110,16	96,89
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	186,57	125,64	135,88
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	105,93	-	98,32
Classe DA	-	97,41	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>31 mars 2019</b>			
Classe AA	183,32	116,04	101,89
Classe AA EUR	-	-	93,86
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	201,92	131,78	140,67
Classe AT EUR	-	-	95,96
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	113,95	-	101,43
Classe DA	-	101,97	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)
	CHF	EUR	CHF
<b>31 mars 2018</b>			
Classe AA	179,32	110,25	102,91
Classe AA EUR	-	-	90,04
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	196,49	124,76	139,40
Classe AT EUR	-	-	90,29
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	110,18	-	100,16
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>TER par part</b>			
Classe AA	1,51%	1,50%	0,96%
Classe AA EUR	-	-	0,84%
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	1,51%	1,51%	0,96%
Classe AT EUR	-	-	0,87%
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	0,89%	-	0,60%
Classe DA	-	0,74%	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>ACTIF NET</b>			
31 mars 2020	18.779.083	-	782.620.467
31 mars 2019	18.705.680	23.819.664	901.857.980
31 mars 2018	17.053.589	-	1.252.988.258
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>			
<b>31 mars 2020</b>			
Classe AA	97,67	-	134,04
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	102,20
Classe AT	98,96	-	175,39
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	104,59
Classe BA	-	-	96,30
Classe BT	-	-	102,56
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>31 mars 2019</b>			
Classe AA	101,90	102,14	141,07
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	103,64
Classe AT	101,90	102,13	182,20
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	105,56
Classe BA	-	-	100,30
Classe BT	-	-	106,03
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>31 mars 2018</b>			
Classe AA	99,67	-	142,23
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	108,74
Classe AT	99,67	-	180,81
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	108,95
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	104,73
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>TER par part</b>			
Classe AA	0,96%	0,43%	1,26%
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	1,26%
Classe AT	0,95%	0,43%	1,26%
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	1,26%
Classe BA	-	-	0,78%
Classe BT	-	-	0,78%
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>ACTIF NET</b>			
31 mars 2020	181.806.673	17.319.054	744.578.993
31 mars 2019	159.635.789	12.299.149	861.464.326
31 mars 2018	151.153.094	-	1.118.793.185
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>			
<b>31 mars 2020</b>			
Classe AA	112,60	100,46	166,62
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	102,33
Classe AT	162,70	101,05	206,57
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	104,10
Classe BA	-	-	92,46
Classe BT	101,83	-	107,46
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>31 mars 2019</b>			
Classe AA	117,72	101,05	180,90
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	107,48
Classe AT	168,76	101,05	222,49
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	108,93
Classe BA	-	-	99,48
Classe BT	105,12	-	115,11
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>31 mars 2018</b>			
Classe AA	117,57	-	181,37
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	112,13
Classe AT	165,44	-	220,65
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	112,35
Classe BA	-	-	-
Classe BT	102,57	-	113,53
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>TER par part</b>			
Classe AA	1,25%	1,26%	1,40%
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	1,42%
Classe AT	1,26%	1,26%	1,40%
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	1,40%
Classe BA	-	-	0,85%
Classe BT	0,78%	-	0,85%
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>ACTIF NET</b>			
31 mars 2020	150.259.608	14.233.199	187.115.533
31 mars 2019	135.296.762	13.635.115	234.592.541
31 mars 2018	137.263.982	-	288.110.741
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>			
<b>31 mars 2020</b>			
Classe AA	124,70	93,99	224,61
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	164,74	94,22	261,70
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	107,89	-	100,30
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>31 mars 2019</b>			
Classe AA	133,92	99,04	250,68
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	109,98
Classe AT	175,75	99,04	290,59
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	111,10
Classe BA	-	-	-
Classe BT	114,47	-	110,71
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>31 mars 2018</b>			
Classe AA	132,37	-	250,30
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	114,38
Classe AT	171,17	-	287,98
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	114,49
Classe BA	-	-	-
Classe BT	110,87	-	109,06
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>TER par part</b>			
Classe AA	1,41%	1,41%	1,55%
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	1,38%
Classe AT	1,41%	1,41%	1,56%
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	1,38%
Classe BA	-	-	-
Classe BT	0,85%	-	0,95%
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>ACTIF NET</b>			
31 mars 2020	43.889.956	12.456.131	155.267.303
31 mars 2019	16.912.459	10.737.267	201.082.330
31 mars 2018	16.562.204	-	235.132.706
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>			
<b>31 mars 2020</b>			
Classe AA	123,77	87,99	278,64
Classe AA EUR	-	-	100,89
Classe AA USD	-	-	103,63
Classe AT	154,34	87,99	306,02
Classe AT EUR	-	-	101,75
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	106,20
Classe DA	-	-	-
Classe DT	91,51	-	117,75
Classe NT	-	-	88,34
<b>31 mars 2019</b>			
Classe AA	137,96	97,05	321,98
Classe AA EUR	-	-	110,37
Classe AA USD	-	-	116,05
Classe AT	170,83	97,05	351,67
Classe AT EUR	-	-	110,99
Classe AT USD	-	-	116,70
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	121,24
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	134,15
Classe NT	-	-	99,80



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>31 mars 2018</b>			
Classe AA	135,45	-	322,04
Classe AA EUR	-	-	104,94
Classe AA USD	-	-	120,84
Classe AT	165,62	-	350,63
Classe AT EUR	-	-	105,07
Classe AT USD	-	-	121,01
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	120,10
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	132,60
Classe NT	-	-	-
<b>TER par part</b>			
Classe AA	1,56%	1,56%	1,71%
Classe AA EUR	-	-	1,70%
Classe AA USD	-	-	1,72%
Classe AT	1,56%	1,56%	1,71%
Classe AT EUR	-	-	1,71%
Classe AT USD	-	-	1,52%
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	1,06%
Classe DA	-	-	-
Classe DT	0,67%	-	0,85%
Classe NT	-	-	0,01%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)*
	EUR	USD
<b>ACTIF NET</b>		
31 mars 2020	-	-
31 mars 2019	8.824.266	11.387.400
31 mars 2018	8.364.670	-
<b>Valeur nette d'inventaire par part</b>		
<b>31 mars 2020</b>		
Classe AA	-	-
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	-	-
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-
<b>31 mars 2019</b>		
Classe AA	100,09	95,39
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	100,14	95,39
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)*
	EUR	USD
<b>31 mars 2018</b>		
Classe AA	97,77	-
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	97,77	-
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-
<b>TER par part</b>		
Classe AA	0,77%	0,77%
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	0,77%	0,77%
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)
	CHF	EUR	CHF
<b>Dividendes distribués</b>			
<b>Date de paiement</b>			
Classe AA	16.07.19	16.07.19	16.07.19
Classe AA EUR	-	-	16.07.19
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	16.07.19	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Dividende par part</b>			
Classe AA	0,95	0,51	1,60
Classe AA EUR	-	-	1,60
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	0,60	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Nombre de parts ayant eu droit au dividende</b>			
Classe AA	318.624	1.909.099	856.705
Classe AA EUR	-	-	100
Classe AA USD	-	-	-
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	16.232	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>Dividendes distribués</b>			
<b>Date de paiement</b>			
Classe AA	16.07.19	-	16.07.19
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	16.07.19
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	16.07.19
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Dividende par part</b>			
Classe AA	1,35	-	1,85
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	0,50
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	0,75
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Nombre de parts ayant eu droit au dividende</b>			
Classe AA	92.020	-	4.271.903
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	1.157
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	6.757
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>Dividendes distribués</b>			
<b>Date de paiement</b>			
Classe AA	16.07.19	16.07.19	16.07.19
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	16.07.19
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	16.07.19
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Dividende par part</b>			
Classe AA	0,95	0,60	1,45
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	0,40
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	0,45
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Nombre de parts ayant eu droit au dividende</b>			
Classe AA	934.127	58.231	2.942.914
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	965
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	9.631
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>Dividendes distribués</b>			
<b>Date de paiement</b>			
Classe AA	16.07.19	16.07.19	16.07.19
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	16.07.19
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Dividende par part</b>			
Classe AA	0,90	0,25	1,30
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	0,45
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Nombre de parts ayant eu droit au dividende</b>			
Classe AA	682.160	64.448	95.212
Classe AA EUR	-	-	-
Classe AA USD	-	-	100
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)
	EUR	USD	CHF
<b>Dividendes distribués</b>			
<b>Date de paiement</b>			
Classe AA	16.07.19	-	16.07.19
Classe AA EUR	-	-	16.07.19
Classe AA USD	-	-	16.07.19
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Dividende par part</b>			
Classe AA	1,00	-	1,80
Classe AA EUR	-	-	0,35
Classe AA USD	-	-	0,35
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-
<b>Nombre de parts ayant eu droit au dividende</b>			
Classe AA	35.230	-	58.284
Classe AA EUR	-	-	430
Classe AA USD	-	-	185
Classe AT	-	-	-
Classe AT EUR	-	-	-
Classe AT USD	-	-	-
Classe BA	-	-	-
Classe BT	-	-	-
Classe DA	-	-	-
Classe DT	-	-	-
Classe NT	-	-	-



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Statistiques (suite)

	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)*	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)*
	EUR	USD
<b>Dividendes distribués</b>		
<b>Date de paiement</b>		
Classe AA	-	-
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	-	-
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-
<b>Dividende par part</b>		
Classe AA	-	-
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	-	-
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-
<b>Nombre de parts ayant eu droit au dividende</b>		
Classe AA	-	-
Classe AA EUR	-	-
Classe AA USD	-	-
Classe AT	-	-
Classe AT EUR	-	-
Classe AT USD	-	-
Classe BA	-	-
Classe BT	-	-
Classe DA	-	-
Classe DT	-	-
Classe NT	-	-

\* Voir la note 12

Les notes annexées font partie intégrante de ces états financiers.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Danemark</b>						
DK0060094928	Orsted	5.404	DKK	524.491	512.348	0,43
DK0010268606	Vestas Wind Systems As / Reg	12.441	DKK	895.721	978.095	0,81
				<b>1.420.212</b>	<b>1.490.443</b>	<b>1,24</b>
<b>Allemagne</b>						
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	41.051	EUR	511.529	514.873	0,43
DE0005664809	Evotec I Inhaber-akt	16.970	EUR	376.919	368.069	0,31
DE000A13SX22	Hella Gmbh & Co. Kгаа	5.921	EUR	294.066	166.956	0,14
DE000LED02V0	Osram Licht N	22.094	EUR	1.233.449	946.449	0,78
				<b>2.415.963</b>	<b>1.996.347</b>	<b>1,66</b>
<b>France</b>						
FR0000120628	Axa	41.048	EUR	1.031.193	688.016	0,57
FR0000120644	Danone.	18.846	EUR	1.573.939	1.173.255	0,98
FR0000121972	Schneider Electric Se	13.334	EUR	1.344.909	1.112.376	0,92
				<b>3.950.041</b>	<b>2.973.647</b>	<b>2,47</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	293.250	GBP	536.586	397.552	0,33
GB00B1YW4409	3i Group Plc	29.968	GBP	412.486	284.820	0,24
				<b>949.072</b>	<b>682.372</b>	<b>0,57</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	6.840	USD	1.106.919	1.080.462	0,90
IE00BZ12WP82	Linde Plc	2.973	USD	465.497	497.639	0,41
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	7.595	USD	672.241	662.692	0,55
				<b>2.244.657</b>	<b>2.240.793</b>	<b>1,86</b>
<b>Israël</b>						
IL0010824113	Check Point Software Techno	5.354	USD	546.713	520.824	0,43
				<b>546.713</b>	<b>520.824</b>	<b>0,43</b>
<b>Japon</b>						
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	39.500	JPY	545.192	591.568	0,49
JP3358000002	Shimano Inc.	5.800	JPY	912.665	802.613	0,67
JP3162600005	Smc Corp	1.800	JPY	546.122	738.065	0,61
JP3435000009	Sony Corp	17.400	JPY	1.006.230	1.001.342	0,83
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	16.900	JPY	729.604	397.298	0,33
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	20.906	JPY	953.054	927.485	0,77
				<b>4.692.867</b>	<b>4.458.371</b>	<b>3,70</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Canada</b>						
CA1363751027	Canadian National Railway	6.309	CAD	493.347	471.882	0,39
CA6330671034	National Bank Of Canada	14.474	CAD	676.829	535.143	0,45
				<b>1.170.176</b>	<b>1.007.025</b>	<b>0,84</b>
<b>Luxembourg</b>						
FR0000038259	Eurofins Scientific Sa	1.095	EUR	503.832	524.288	0,44
				<b>503.832</b>	<b>524.288</b>	<b>0,44</b>
<b>Pays-Bas</b>						
NL0010273215	Asml Holding Nv	2.635	EUR	733.075	678.238	0,56
NL0011821202	Ing Group Nv	57.161	EUR	474.815	290.164	0,24
NL0000388619	Unilever Nv.	18.343	EUR	916.522	872.521	0,73
				<b>2.124.412</b>	<b>1.840.923</b>	<b>1,53</b>
<b>Norvège</b>						
NO0010063308	Telenor As.	33.564	NOK	598.994	469.758	0,39
				<b>598.994</b>	<b>469.758</b>	<b>0,39</b>
<b>Suisse</b>						
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	536	CHF	510.585	358.584	0,30
CH0418792922	Sika Ltd	3.352	CHF	161.676	536.153	0,44
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	2.868	CHF	419.657	500.179	0,42
				<b>1.091.918</b>	<b>1.394.916</b>	<b>1,16</b>
<b>Singapour</b>						
SG1S04926220	Oversea-chinese Bk Corp	71.618	SGD	577.985	420.480	0,35
				<b>577.985</b>	<b>420.480</b>	<b>0,35</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US00846U1016	Agilent Technologies	14.141	USD	724.656	979.914	0,81
US0126531013	Albemarle Corp	7.528	USD	590.232	410.583	0,34
US0162551016	Align Technology Inc	2.495	USD	478.801	419.922	0,35
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	1.778	USD	1.995.748	1.998.908	1,67
US0304201033	American Water Works Co Inc	8.764	USD	673.505	1.013.822	0,84
US03662Q1058	Ansys Inc	2.230	USD	308.526	501.586	0,42
US1091941005	Bright Family Sol	5.724	USD	442.190	564.902	0,47
US15135B1017	Centene Corp. De	18.564	USD	940.479	1.067.099	0,89
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	17.685	USD	595.363	672.638	0,56
US2786421030	Ebay Inc	17.589	USD	550.921	511.568	0,42
US2788651006	Ecolab Inc.	6.178	USD	978.417	931.478	0,77
US29261A1007	Encompass Hlth Registered	10.964	USD	676.465	679.244	0,56
US29670G1022	Essential Util Rg	13.109	USD	500.124	516.223	0,43
US3364331070	First Solar Inc	17.156	USD	835.329	598.571	0,50
US3687361044	General Hldg	11.864	USD	1.002.687	1.069.500	0,89
US49338L1035	Keysight Technologies Inc	8.216	USD	559.271	665.205	0,55
US5717481023	Marsh & Mc-lennan Cos Inc	7.087	USD	447.033	592.859	0,49
US5745991068	Masco Corp.	34.317	USD	1.255.181	1.147.842	0,95

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US58933Y1055	Merck	14.644	USD	1.171.299	1.090.148	0,91
US5951121038	Micron Technology Inc	23.505	USD	868.149	956.540	0,79
US5949181045	Microsoft Corp.	15.791	USD	1.819.435	2.409.586	2,01
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	7.709	USD	357.079	373.539	0,31
US6821891057	On Semiconductor Corp	28.374	USD	599.249	341.519	0,28
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	6.547	USD	471.521	606.470	0,50
US83417M1045	Solaredge Technologies Inc	14.487	USD	718.746	1.147.704	0,95
US78409V1044	S&p Global Shs	2.350	USD	552.854	557.181	0,46
US78486Q1013	Svb Financial Group	5.684	USD	947.964	830.873	0,69
US8725901040	T-mobile Us Inc	10.545	USD	675.162	856.016	0,71
US8923561067	Tractor Supply Co	13.398	USD	1.045.249	1.096.042	0,91
US8962391004	Trimble Navigation Ltd	8.266	USD	307.558	254.569	0,21
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	5.012	USD	978.785	1.209.334	1,00
US9139031002	Univ.health Serv.inc B	7.624	USD	966.793	730.874	0,61
US92826C8394	Visa Inc -a	4.289	USD	738.873	668.620	0,56
US9839191015	Xilinx Inc.	3.468	USD	256.926	261.525	0,22
US98419M1009	Xylem Inc	7.514	USD	554.787	473.506	0,39
				<b>26.585.357</b>	<b>28.205.910</b>	<b>23,42</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>48.872.199</b>	<b>48.226.097</b>	<b>40,06</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
USQ04578AD42	Apt Pipelin 4.2% 15-23.03.25	200.000	USD	193.658	202.731	0,17
CH0512502995	Cw Bk Austr 0.113% 19-10.12.29	500.000	CHF	500.000	453.625	0,38
CH0340912168	Transurban 0.65% 16-02.11.26	500.000	CHF	477.524	461.125	0,38
CH0417086060	Westpac Bk 0.4% 18-06.06.24	500.000	CHF	501.225	490.750	0,41
XS1506398244	Westpac Bk 0.875% 16-17.04.27	1.000.000	EUR	1.111.734	1.019.275	0,84
				<b>2.784.141</b>	<b>2.627.506</b>	<b>2,18</b>
<b>Brésil</b>						
USP1R027AA25	Banbra 4.75% 19-20.03.24	500.000	USD	504.199	473.848	0,39
				<b>504.199</b>	<b>473.848</b>	<b>0,39</b>
<b>Caïmans (Iles)</b>						
CH0494734343	Banort 0.45% 19-18.12.23	500.000	CHF	500.870	465.875	0,39
				<b>500.870</b>	<b>465.875</b>	<b>0,39</b>
<b>Chili</b>						
CH0479222066	Bco Dest Cl 0.24% 19-06.06.25	500.000	CHF	500.000	442.000	0,37
				<b>500.000</b>	<b>442.000</b>	<b>0,37</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	600.000	USD	606.505	619.414	0,51
				<b>606.505</b>	<b>619.414</b>	<b>0,51</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Danemark</b>						
CH0026985520	Kommkrdt 2.875% 06-13.10.31	900.000	CHF	1.208.760	1.187.550	0,99
				<b>1.208.760</b>	<b>1.187.550</b>	<b>0,99</b>
<b>Allemagne</b>						
CH0479514272	Dt Bahn Fin 0.10% 19-19.06.29	520.000	CHF	520.260	500.630	0,42
CH0235834154	Dt Bahn Fin 1.5% 14-26.08.24	200.000	CHF	221.186	214.300	0,18
XS2101357072	Fresenius 0.75% 20-15.01.28	500.000	EUR	538.762	499.822	0,42
XS2034715305	Kfw 0.875% 19-15.09.26	100.000	GBP	122.283	120.839	0,10
US500769BN36	Kfw 2.05% 06-16.02.26	100.000.000	JPY	1.044.257	1.021.828	0,84
US515110BL73	Lwf Rentbk 2.25% 14-01.10.21	500.000	USD	482.260	496.387	0,41
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	300.000	EUR	322.886	302.766	0,25
				<b>3.251.894</b>	<b>3.156.572</b>	<b>2,62</b>
<b>Finlande</b>						
CH0185907083	Muni Fin 1.375% 12-08.06.27	2.000.000	CHF	2.254.300	2.217.500	1,84
				<b>2.254.300</b>	<b>2.217.500</b>	<b>1,84</b>
<b>France</b>						
US05574LFY92	Bnp Us Med 3.25% 13-03.03.23	1.500.000	USD	1.441.418	1.493.268	1,24
XS0092663649	Rff 5.5% 98-01.12.21	600.000	GBP	1.334.186	777.631	0,65
US80105NAG07	Sanofi 4% 11-29.03.21	1.500.000	USD	1.671.651	1.484.401	1,23
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	1.000.000	EUR	1.123.482	1.158.807	0,96
				<b>5.570.737</b>	<b>4.914.107</b>	<b>4,08</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	1.250.000	EUR	1.779.383	1.538.881	1,28
US404280AG49	Hsbc Hldg 6.5% 06-02.05.36	700.000	USD	872.921	828.543	0,69
CH0429659607	Lloyds Bk 1% 18-04.03.25	500.000	CHF	499.825	479.000	0,40
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	300.000	EUR	332.583	304.887	0,25
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	150.000	EUR	162.142	153.587	0,13
XS2080205367	Rbs Group 0.75% 19-15.11.25	300.000	EUR	328.415	289.205	0,24
XS1875284702	Sse 1.375% 18-04.09.27	1.000.000	EUR	1.115.562	1.081.646	0,90
XS2021467753	Std Chart 0.9% 19-02.07.27	500.000	EUR	558.570	471.960	0,39
GB00B52WS153	Uk Tsy 4.5% 09-7.9.34	1.000.000	GBP	1.916.549	1.847.081	1,54
XS2016070430	Wstp 0.3% 19-25.06.24	400.000	EUR	447.424	405.493	0,34
				<b>8.013.374</b>	<b>7.400.283</b>	<b>6,16</b>
<b>Honduras</b>						
CH0398677713	Cabei 0.314% 18-05.09.24	500.000	CHF	495.650	497.250	0,41
				<b>495.650</b>	<b>497.250</b>	<b>0,41</b>
<b>Irlande</b>						
XS2013626010	Zurich Fina 1.625% 19-17.06.39	100.000	EUR	112.234	96.636	0,08
				<b>112.234</b>	<b>96.636</b>	<b>0,08</b>
<b>Canada</b>						
CH0413618346	Cibc 0.1% 18-30.04.25	500.000	CHF	496.410	504.875	0,42

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS1945965611	Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	500.000	EUR	565.208	563.086	0,46
CA30216BHL95	Edc 1.65% 19-31.07.24	500.000	CAD	374.731	349.126	0,29
US748149AQ48	Quebec Prov 2.5% 19-09.04.24 Sr Qw	350.000	USD	348.647	360.766	0,30
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	200.000	EUR	226.832	201.617	0,17
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	300.000	USD	297.671	296.483	0,25
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	300.000	EUR	340.176	299.591	0,25
				<b>2.649.675</b>	<b>2.575.544</b>	<b>2,14</b>
	<b>Kazakhstan</b>					
CH0448036266	Nat Kazak 3.25% 18-05.12.23	420.000	CHF	437.800	400.155	0,33
				<b>437.800</b>	<b>400.155</b>	<b>0,33</b>
	<b>Luxembourg</b>					
US298785DV50	Bei 4.875% 06-15.02.36	800.000	USD	903.707	1.158.042	0,96
				<b>903.707</b>	<b>1.158.042</b>	<b>0,96</b>
	<b>Mexique</b>					
USP4949BAJ37	Grupo Bimbo 3.875% 14-27.06.24	500.000	USD	484.030	484.254	0,40
				<b>484.030</b>	<b>484.254</b>	<b>0,40</b>
	<b>Pays-Bas</b>					
DE000A2RWAY2	Allianz Fin 1.5% 19-15.01.30	500.000	EUR	609.872	540.351	0,45
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	1.000.000	CHF	1.001.250	921.250	0,77
XS0401016919	Deut Tel If 8.875% 08-27.11.28	400.000	GBP	856.481	729.973	0,61
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	100.000	EUR	114.100	107.226	0,09
USN4580HAA51	Ing Groe 4.625% 18-06.1.26 Regs	500.000	USD	508.773	509.101	0,42
NL0000102234	Netherlands 4% 05-15.01.37	500.000	EUR	735.364	891.410	0,74
XS1386139841	Nwb 2.375% 16-24.03.26 Regs	1.500.000	USD	1.448.097	1.583.324	1,31
				<b>5.273.937</b>	<b>5.282.635</b>	<b>4,39</b>
	<b>Philippines</b>					
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	100.000.000	JPY	950.954	1.066.793	0,89
				<b>950.954</b>	<b>1.066.793</b>	<b>0,89</b>
	<b>Pologne</b>					
XS1958534528	Poland 1% 19-07.03.29 Regs	200.000	EUR	225.654	225.341	0,19
				<b>225.654</b>	<b>225.341</b>	<b>0,19</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	100.000	EUR	113.306	109.859	0,09
				<b>113.306</b>	<b>109.859</b>	<b>0,09</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0525158371	Zuerich Ver 0.10% 20-27.08.32	300.000	CHF	301.308	273.000	0,23
				<b>301.308</b>	<b>273.000</b>	<b>0,23</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	100.000	EUR	106.982	102.791	0,09

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

## Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
ES0200002048	Adif Alta V 0.95% 19-30.04.27	500.000	EUR	563.239	540.797	0,45
XS2013745703	Bbva 1% 19-21.06.26	200.000	EUR	224.428	196.464	0,16
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	200.000	EUR	222.365	202.386	0,17
CH0438965540	Santan Cons 0.625% 18-24.10.22	1.000.000	CHF	1.000.990	972.250	0,81
XS1384064587	Santander I 3.25% 16-04.04.26	1.000.000	EUR	1.264.144	1.057.908	0,88
CH0428194200	Santander 1% 18-10.12.24	1.500.000	CHF	1.488.075	1.435.124	1,18
				<b>4.870.223</b>	<b>4.507.720</b>	<b>3,74</b>
	<b>Corée du Sud</b>					
CH0461238856	Kor Railrd 0.0% 19-19.11.24	500.000	CHF	504.525	489.625	0,40
XS1999730374	Kr Hous Fin 0.10% 19-18.06.24	325.000	EUR	364.817	346.473	0,29
				<b>869.342</b>	<b>836.098</b>	<b>0,69</b>
	<b>Venezuela</b>					
XS2081543204	Corp An 0.625% 19-20.11.26 Regs	250.000	EUR	271.926	266.608	0,22
XS1943474483	Corp Andina 0.625% 19-30.01.24	500.000	EUR	564.263	532.086	0,44
				<b>836.189</b>	<b>798.694</b>	<b>0,66</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US00037BAB80	Abb Fin Usa 2.875%12-08.05.22	1.500.000	USD	1.420.796	1.466.158	1,22
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	500.000	EUR	546.352	496.335	0,41
CH0474977722	Bac 0.252% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	1.000.000	935.500	0,78
US17275RAN26	Cisco Sys 3.625% 14-04.03.24	500.000	USD	528.874	525.878	0,44
CH0467182405	Citigroup I 0.75% 19-02.04.26	1.000.000	CHF	1.007.340	960.000	0,80
US370334CG79	Gen Mills 4.2% 18-17.04.28	750.000	USD	732.024	803.954	0,67
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	200.000	USD	195.640	172.452	0,14
US4581X0CC06	Iadb 3% 13-04.10.23	2.500.000	USD	2.517.313	2.617.878	2,17
XS1944456109	Ibm Corp 0.875% 19-31.01.25	500.000	EUR	567.227	529.166	0,44
US459200KA85	Ibm Corp 3.50% 19-15.05.29	500.000	USD	530.128	527.924	0,44
CA459058HS51	Intl Bk Rec 1.90% 20-16.01.25	300.000	CAD	223.747	211.515	0,18
XS2075811948	Jpm Frn 19-04.11.32	500.000	EUR	550.903	477.692	0,40
CH0482172340	Met Life 0.125% 19-11.06.27	500.000	CHF	500.000	475.125	0,39
US59217HBB24	Met Life 3.45% 16-18.12.26	500.000	USD	489.138	508.730	0,42
XS1197270819	Mondelez 1.625% 15-08.03.27	500.000	EUR	566.568	538.599	0,45
CH0423233540	North Am 0.3% 18-24.07.26	700.000	CHF	700.826	715.050	0,59
US66989HAE80	Novartis Cap 2.4% 12-21.9.22	1.000.000	USD	941.492	989.398	0,82
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	200.000	EUR	217.931	178.259	0,15
US87612EBA38	Target Corp 4%12-1.7.42	700.000	USD	592.451	789.850	0,66
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	500.000	USD	504.533	507.466	0,42
US92343VCR33	Verizon Com 3.5% 14-01.11.24	1.500.000	USD	1.408.282	1.547.156	1,29
				<b>15.741.565</b>	<b>15.974.085</b>	<b>13,28</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>59.460.354</b>	<b>57.790.761</b>	<b>48,01</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>108.332.553</b>	<b>106.016.858</b>	<b>88,07</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Canada</b>						
CA58458F1018	Medical Intellig Techs Com	310.000	CAD	214.578	0	0,00
				<b>214.578</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>214.578</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Côte d'Ivoire</b>						
US008281BC08	Adb 0.75% 20-03.04.23	200.000	USD	192.642	194.290	0,16
				<b>192.642</b>	<b>194.290</b>	<b>0,16</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>192.642</b>	<b>194.290</b>	<b>0,16</b>
<b>Droits</b>						
<b>Autriche</b>						
AT0000A10BA2	Rights Intercell Ag	84.229	EUR	0	0	0,00
				<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total - Droits</b>				<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>407.220</b>	<b>194.290</b>	<b>0,16</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Luxembourg</b>						
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	116.715	USD	11.912.628	10.134.138	8,42
				<b>11.912.628</b>	<b>10.134.138</b>	<b>8,42</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>11.912.628</b>	<b>10.134.138</b>	<b>8,42</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>11.912.628</b>	<b>10.134.138</b>	<b>8,42</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>120.652.401</b>	<b>116.345.286</b>	<b>96,65</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Etats-Unis d'Amérique	36,70	Banques et autres institutions financières	19,77
Luxembourg	9,82	Holdings et sociétés financières	10,58
Royaume-Uni	6,73	Fonds d'investissements	8,42
France	6,55	Electrotechnique, électronique	6,81
Pays-Bas	5,92	Supranational	6,53
Allemagne	4,28	Obligations d'Etats et de villes étrangers	5,39
Espagne	3,74	Pharmacie et cosmétique	5,12
Japon	3,70	Internet Software	4,53
Canada	2,98	Santé, éducation et services sociaux	3,95
Danemark	2,23	Energie et service des eaux	3,89
Australie	2,18	Transmission de nouvelles	3,15
Irlande	1,94	Alimentation, boissons	2,81
Finlande	1,84	Articles de bureau et ordinateurs	2,29
Suisse	1,39	Commerce de détail et grands magasins	1,99
Philippines	0,89	Circulation et transport	1,85
Corée du Sud	0,69	Assurances	1,74
Venezuela	0,66	Biens de consommation divers	1,68
Chine	0,51	Chimie	1,55
Israël	0,43	Services divers	1,46
Honduras	0,41	Mécanique, outillage	0,91
Mexique	0,40	Biotechnologie	0,81
Norvège	0,39	Véhicules routiers	0,81
Caïmans (Iles)	0,39	Arts graphiques et maisons d'édition	0,46
Brésil	0,39	Sociétés immobilières	0,15
Chili	0,37		<b>96,65</b>
Singapour	0,35		
Kazakhstan	0,33		
Pologne	0,19		
Côte d'Ivoire	0,16		
Portugal	0,09		
	<b>96,65</b>		

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Danemark</b>						
DK0060094928	Orsted	16.212	DKK	1.447.060	1.447.796	0,42
DK0010268606	Vestas Wind Systems As / Reg	37.264	DKK	2.531.320	2.759.537	0,80
				<b>3.978.380</b>	<b>4.207.333</b>	<b>1,22</b>
<b>Allemagne</b>						
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	123.047	EUR	1.454.531	1.453.677	0,42
DE0005664809	Evotec I Inhaber-akt	51.813	EUR	1.124.728	1.058.540	0,31
DE000A13SX22	Hella Gmbh & Co. Kгаа	15.682	EUR	708.243	416.514	0,12
DE000LED02V0	Osram Licht N	50.928	EUR	2.209.903	2.054.945	0,59
				<b>5.497.405</b>	<b>4.983.676</b>	<b>1,44</b>
<b>France</b>						
FR0000120628	Axa	122.954	EUR	2.740.191	1.941.198	0,56
FR0000120644	Danone.	54.236	EUR	4.084.601	3.180.399	0,92
FR0000121972	Schneider Electric Se	39.909	EUR	3.778.900	3.136.049	0,91
				<b>10.603.692</b>	<b>8.257.646</b>	<b>2,39</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	865.562	GBP	1.463.660	1.105.287	0,32
GB00B1YW4409	3i Group Plc	86.136	GBP	1.099.159	771.113	0,22
				<b>2.562.819</b>	<b>1.876.400</b>	<b>0,54</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	20.522	USD	3.147.302	3.053.471	0,88
IE00BZ12WP82	Linde Plc	8.896	USD	1.371.290	1.402.605	0,41
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	22.789	USD	1.930.972	1.872.966	0,54
				<b>6.449.564</b>	<b>6.329.042</b>	<b>1,83</b>
<b>Israël</b>						
IL0010824113	Check Point Software Techno	16.113	USD	1.493.313	1.476.419	0,43
				<b>1.493.313</b>	<b>1.476.419</b>	<b>0,43</b>
<b>Japon</b>						
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	120.800	JPY	1.555.762	1.704.100	0,49
JP3358000002	Shimano Inc.	17.300	JPY	2.360.608	2.254.992	0,65
JP3162600005	Smc Corp	5.500	JPY	1.649.351	2.124.249	0,62
JP3435000009	Sony Corp	52.000	JPY	2.789.333	2.818.758	0,82
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	50.300	JPY	1.704.644	1.113.828	0,32
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	63.620	JPY	2.751.580	2.658.585	0,77
				<b>12.811.278</b>	<b>12.674.512</b>	<b>3,67</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Canada</b>						
CA1363751027	Canadian National Railway	19.808	CAD	1.614.612	1.395.515	0,40
CA25490H1064	Dirtt Envir Sol	202.321	CAD	942.421	183.955	0,05
CA6330671034	National Bank Of Canada	43.360	CAD	1.839.469	1.510.049	0,45
CA85472N1096	Stantec Inc	30.080	CAD	664.223	693.367	0,20
				<b>5.060.725</b>	<b>3.782.886</b>	<b>1,10</b>
<b>Luxembourg</b>						
FR0000038259	Eurofins Scientific Sa	3.271	EUR	1.332.848	1.475.221	0,43
				<b>1.332.848</b>	<b>1.475.221</b>	<b>0,43</b>
<b>Pays-Bas</b>						
NL0010273215	Asml Holding Nv	7.873	EUR	1.959.040	1.908.809	0,55
NL0011821202	Ing Group Nv	171.237	EUR	1.320.123	818.770	0,24
NL0000388619	Unilever Nv.	52.069	EUR	2.494.515	2.332.951	0,68
				<b>5.773.678</b>	<b>5.060.530</b>	<b>1,47</b>
<b>Norvège</b>						
NO0010063308	Telenor As.	96.701	NOK	1.565.831	1.274.830	0,37
				<b>1.565.831</b>	<b>1.274.830</b>	<b>0,37</b>
<b>Suisse</b>						
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	1.674	CHF	1.410.930	1.054.878	0,31
CH0418792922	Sika Ltd	9.880	CHF	973.695	1.488.546	0,43
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	8.609	CHF	1.443.709	1.414.230	0,41
				<b>3.828.334</b>	<b>3.957.654</b>	<b>1,15</b>
<b>Singapour</b>						
SG1S04926220	Oversea-chinese Bk Corp	213.466	SGD	1.547.686	1.180.518	0,34
				<b>1.547.686</b>	<b>1.180.518</b>	<b>0,34</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US00846U1016	Agilent Technologies	42.832	USD	2.419.897	2.795.742	0,81
US0126531013	Albemarle Corp	23.774	USD	1.712.630	1.221.363	0,35
US0162551016	Align Technology Inc	7.487	USD	1.377.640	1.186.934	0,34
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	5.370	USD	5.668.838	5.686.644	1,66
US0304201033	American Water Works Co Inc	26.260	USD	2.317.801	2.861.377	0,83
US03662Q1058	Ansys Inc	6.690	USD	1.068.701	1.417.384	0,41
US1091941005	Bright Family Sol	17.162	USD	1.670.918	1.595.374	0,46
US15135B1017	Centene Corp. De	55.725	USD	2.649.849	3.017.200	0,87
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	53.007	USD	1.889.067	1.899.025	0,55
US2786421030	Ebay Inc	52.798	USD	1.595.824	1.446.441	0,42
US2788651006	Ecolab Inc.	18.818	USD	2.877.318	2.672.508	0,77
US29261A1007	Encompass Hlth Registered	32.990	USD	1.911.164	1.925.131	0,56
US29670G1022	Essential Util Rg	39.382	USD	1.412.995	1.460.786	0,42
US3364331070	First Solar Inc	52.524	USD	2.400.557	1.726.148	0,50
US3687361044	General Hldg	35.750	USD	2.906.832	3.035.614	0,88
US49338L1035	Keysight Technologies Inc	24.626	USD	1.709.231	1.878.062	0,54

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US5717481023	Marsh & Mc-lennan Cos Inc	21.743	USD	1.605.325	1.713.283	0,50
US5745991068	Masco Corp.	94.984	USD	3.292.166	2.992.570	0,87
US589333Y1055	Merck	44.339	USD	3.225.745	3.109.084	0,90
US5951121038	Micron Technology Inc	70.542	USD	2.545.229	2.704.030	0,78
US5949181045	Microsoft Corp.	50.703	USD	6.094.371	7.287.646	2,12
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	23.139	USD	1.013.230	1.056.096	0,31
US6821891057	On Semiconductor Corp	87.223	USD	1.586.011	988.885	0,29
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	19.518	USD	1.534.270	1.703.033	0,49
US83417M1045	Solaredge Technologies Inc	39.229	USD	1.964.384	2.927.383	0,85
US78409V1044	S&p Global Shs	7.042	USD	1.561.205	1.572.697	0,46
US78486Q1013	Svb Financial Group	17.027	USD	3.066.123	2.344.442	0,68
US8725901040	T-mobile Us Inc	32.208	USD	2.046.121	2.462.749	0,71
US8923561067	Tractor Supply Co	40.152	USD	3.086.970	3.093.964	0,90
US8962391004	Trimble Navigation Ltd	24.811	USD	861.256	719.739	0,21
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	15.046	USD	3.055.338	3.419.614	0,99
US9139031002	Univ.health Serv.inc B	23.115	USD	2.701.161	2.087.249	0,61
US92826C8394	Visa Inc -a	11.830	USD	2.051.549	1.737.115	0,50
US9839191015	Xilinx Inc.	10.515	USD	801.942	746.903	0,22
US98419M1009	Xylem Inc	22.872	USD	1.541.893	1.357.624	0,39
				<b>79.223.551</b>	<b>79.849.839</b>	<b>23,15</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>141.729.104</b>	<b>136.386.506</b>	<b>39,53</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
USQ0426RND62	Anz Bk 4.4% 16-19.05.26	700.000	USD	670.978	660.734	0,19
USQ04578AD42	Apt Pipelin 4.2% 15-23.03.25	200.000	USD	171.740	190.959	0,06
US2027A1JT52	Cw Bk Austr 3.15% 17-19.09.27	500.000	USD	450.658	472.431	0,14
XS0864360358	Nab Aus 1.875% 13.1.23 Emtn	300.000	EUR	291.390	316.350	0,09
XS1872032799	Nat Aus Bk 1.375% 18-30.08.28	1.500.000	EUR	1.634.735	1.488.180	0,43
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	500.000	EUR	499.400	474.960	0,14
XS1506398244	Westpac Bk 0.875% 16-17.04.27	1.000.000	EUR	981.800	960.090	0,28
XS1558450745	Westpac Bk 2.125% 17-02.05.25	1.000.000	GBP	1.180.741	1.111.090	0,32
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	200.000	USD	180.060	181.851	0,05
				<b>6.061.502</b>	<b>5.856.645</b>	<b>1,70</b>
<b>Belgique</b>						
BE0000333428	Belgcoopdom 3% 14-22.06.34	500.000	EUR	705.885	687.975	0,20
BE0000346552	Belgium 1.25% 18-22.04.33 Regs	1.500.000	EUR	1.708.545	1.699.515	0,49
				<b>2.414.430</b>	<b>2.387.490</b>	<b>0,69</b>
<b>Brésil</b>						
USP1R027AA25	Banbra 4.75% 19-20.03.24	1.000.000	USD	899.256	892.668	0,26
				<b>899.256</b>	<b>892.668</b>	<b>0,26</b>
<b>Caimans (Iles)</b>						
USP3772WAH53	Banbra 4.625% 17-15.01.25	500.000	USD	466.592	439.973	0,12

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0494734343	Banort 0.45% 19-18.12.23	500.000	CHF	461.276	438.824	0,13
				<b>927.868</b>	<b>878.797</b>	<b>0,25</b>
<b>Chili</b>						
CH0479222066	Bco Dest Cl 0.24% 19-06.06.25	500.000	CHF	442.977	416.335	0,12
US05968AAG13	Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	200.000	USD	178.739	170.987	0,05
CH0506071239	Credito 0.10% 20-18.09.26	1.000.000	CHF	942.284	831.729	0,24
CH0494734376	Credito 0.25% 19-24.09.29	1.000.000	CHF	889.137	791.932	0,23
				<b>2.453.137</b>	<b>2.210.983</b>	<b>0,64</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	600.000	USD	532.800	583.448	0,17
				<b>532.800</b>	<b>583.448</b>	<b>0,17</b>
<b>Danemark</b>						
XS1422951993	Kommkrdt 1.625% 16-01.06.21	1.500.000	USD	1.271.822	1.384.033	0,40
				<b>1.271.822</b>	<b>1.384.033</b>	<b>0,40</b>
<b>Allemagne</b>						
CH0479514272	Dt Bahn Fin 0.10% 19-19.06.29	520.000	CHF	462.182	471.561	0,14
XS2101357072	Fresenius 0.75% 20-15.01.28	1.600.000	EUR	1.600.919	1.506.560	0,44
DE0001135226	Germany 4.75% 03-04.07.34	1.800.000	EUR	2.957.145	3.144.726	0,92
DE0001135044	Germany 6.5% 97-04.07.27	1.000.000	EUR	1.221.989	1.527.150	0,44
DE000A11QTF7	Kfw 0.375% 15-23.04.30	1.000.000	EUR	1.032.800	1.034.290	0,30
XS2034715305	Kfw 0.875% 19-15.09.26	300.000	GBP	334.022	341.467	0,10
US500769JE54	Kfw 1.625% 20-15.02.23	1.000.000	USD	930.615	938.346	0,27
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	1.000.000	USD	889.774	971.711	0,28
US500769BN36	Kfw 2.05% 06-16.02.26	60.000.000	JPY	503.592	577.497	0,17
US500769EQ30	Kfw 2.375% 11-25.08.21	100.000	USD	75.268	93.543	0,03
DE0002760980	Kfw 3.5% 06-04.07.21	1.000.000	EUR	864.369	1.049.550	0,30
XS0138039275	Kfw 5% 01-09.06.36	100.000	GBP	123.632	180.674	0,05
XS0138036842	Kfw 5.5% 01-18.06.25	100.000	GBP	129.369	140.280	0,04
XS1598037759	Ldkr B-w 0.875% 17-07.03.22	500.000	GBP	575.879	566.975	0,16
US515110BN30	Lwf Rentbk 2% 15-13.01.25	500.000	USD	434.880	484.976	0,14
US515110BL73	Lwf Rentbk 2.25% 14-01.10.21	2.000.000	USD	1.594.646	1.870.257	0,54
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	800.000	EUR	797.088	760.496	0,22
				<b>14.528.169</b>	<b>15.660.059</b>	<b>4,54</b>
<b>France</b>						
US05574LFY92	Bnp Us Med 3.25% 13-03.03.23	1.800.000	USD	1.499.495	1.687.874	0,49
FR0013459757	C Fr Fi Loc 0.10% 19-13.11.29	1.000.000	EUR	999.175	988.180	0,29
FR0013230703	C Fr Fi Loc 0.75% 17-11.01.27	500.000	EUR	498.380	524.710	0,15
FR0010198036	Cades 3.75% 05-25.10.20	2.000.000	EUR	1.785.401	2.045.901	0,59
FR0013413382	Cff 0.375% 19-09.04.27	800.000	EUR	799.752	817.208	0,24
FR0013160959	Cff 1.2% 16-29.04.31	1.000.000	EUR	1.100.730	1.106.330	0,32
USF12033TP59	Danone 2.947% 16-02.11.26	500.000	USD	446.760	458.715	0,13
FR0013313582	France 1.25% 17-25.05.34 /oat	1.500.000	EUR	1.709.680	1.703.250	0,49
FR0000188799	France 3.15% 02-25.7.32 Oat	500.000	EUR	1.002.925	941.702	0,27
XS0255800285	Rff 4.375% 06-2.6.22	200.000	EUR	191.407	220.498	0,06

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS0092663649	Rff 5.5% 98-01.12.21	1.150.000	GBP	1.734.426	1.403.914	0,41
US80105NAG07	Sanofi 4% 11-29.03.21	500.000	USD	507.328	466.070	0,14
XS0144628053	Sncf 5.375% 02-18.03.27	100.000	GBP	129.837	145.878	0,04
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	1.000.000	EUR	988.670	1.091.520	0,32
				<b>13.393.966</b>	<b>13.601.750</b>	<b>3,94</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
XS0260981658	Bk Of Scot 4.5% 06-13.07.21	2.500.000	EUR	2.871.999	2.648.201	0,77
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	1.500.000	EUR	1.722.470	1.739.430	0,50
US404280AG49	Hsbc Hldg 6.5% 06-02.05.36	800.000	USD	932.301	891.924	0,26
CH0429659607	Lloyds Bk 1% 18-04.03.25	150.000	CHF	131.493	135.356	0,04
US539439AT62	Lloyds Bk 4.55% 18-16.08.28	1.000.000	USD	1.005.143	948.805	0,28
XS0422704071	Lloyds 7.5% 09-15.4.24	1.000.000	GBP	1.448.669	1.337.405	0,39
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	800.000	EUR	803.480	765.824	0,22
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	500.000	EUR	500.000	482.230	0,14
XS2080205367	Rbs Group 0.75% 19-15.11.25	1.500.000	EUR	1.504.005	1.362.060	0,39
XS0140516864	Smithkl.beech.5.25% 01-19.12.33 Emtn	700.000	GBP	1.178.060	1.074.457	0,31
XS1875284702	Sse 1.375% 18-04.09.27	1.000.000	EUR	980.340	1.018.840	0,30
XS2021467753	Std Chart 0.9% 19-02.07.27	1.000.000	EUR	1.016.900	889.110	0,26
XS0479869744	Vodafone 4.65% 10-20.1.22	800.000	EUR	977.360	856.856	0,25
XS2016070430	Wstp 0.3% 19-25.06.24	700.000	EUR	699.447	668.409	0,19
				<b>15.771.667</b>	<b>14.818.907</b>	<b>4,30</b>
	<b>Honduras</b>					
CH0398677713	Cabei 0.314% 18-05.09.24	200.000	CHF	173.973	187.351	0,05
				<b>173.973</b>	<b>187.351</b>	<b>0,05</b>
	<b>Irlande</b>					
XS2013626010	Zurich Fina 1.625% 19-17.06.39	500.000	EUR	545.945	455.125	0,13
				<b>545.945</b>	<b>455.125</b>	<b>0,13</b>
	<b>Japon</b>					
XS0241265445	East Jap.railway 4.5% 06-25.01.36	300.000	GBP	397.607	446.931	0,13
XS2113121904	Jfm 0.05% 20-12.02.27	300.000	EUR	299.601	300.270	0,09
				<b>697.208</b>	<b>747.201</b>	<b>0,22</b>
	<b>Canada</b>					
US064159QD10	Bk N Scotia 2.375% 19-18.01.23	600.000	USD	544.292	549.266	0,16
CA13509PHD83	Can Housing 2.1% 19-15.09.29	500.000	CAD	346.387	341.894	0,10
CA13509PEF68	Can Housing 2.9% 14-15.06.24	1.000.000	CAD	721.437	690.095	0,20
XS2025468542	Cibc 0.04% 19-09.07.27	600.000	EUR	599.952	589.272	0,17
CH0413618346	Cibc 0.1% 18-30.04.25	500.000	CHF	434.726	475.559	0,14
XS1991125896	Cibc 0.375% 19-03.05.24	1.000.000	EUR	1.000.114	940.920	0,27
US13607GAP90	Cibc 3.1% 19-02.04.24	1.000.000	USD	904.855	943.094	0,27
XS1945965611	Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	500.000	EUR	498.570	530.390	0,15
USC60191BE98	Natl Bk 2.05% 19-20.06.22	300.000	USD	265.804	281.550	0,08
US63307A2J35	Natl Bk 2.10% 20-01.02.23	500.000	USD	450.200	450.868	0,13
US68323AFG40	Ontario 2% 19-02.10.29	1.500.000	USD	1.327.722	1.444.813	0,42

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CA68333ZAH07	Ontario 2.05% 19-02.06.30	1.000.000	CAD	707.813	647.592	0,19
CA68323AER10	Ontario 2.65% 18-05.02.25	1.000.000	CAD	703.704	676.809	0,20
US68323AFC36	Ontario 3.05% 19-29.01.24	500.000	USD	464.085	492.736	0,14
CA683234VR64	Ontario 5.6% 04-2.6.35 Dmtn119	1.000.000	CAD	984.793	905.799	0,26
CA74814ZFF59	Quebec Prov 2.3% 19-01.09.29	2.000.000	CAD	1.424.304	1.333.602	0,39
US748149AQ48	Quebec Prov 2.5% 19-09.04.24 Sr Qw	700.000	USD	623.954	679.636	0,20
US748149AN17	Quebec Prov 2.75% 17-12.04.27	500.000	USD	465.157	504.165	0,15
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	1.000.000	EUR	1.000.734	949.550	0,28
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	600.000	USD	534.696	558.535	0,16
US78013XW204	Rbc 3.7% 18-05.10.23	1.250.000	USD	1.152.516	1.205.616	0,35
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	1.000.000	EUR	997.270	940.650	0,27
US89114QCA40	Tor Dom Bk 2.65% 19-12.06.24	1.000.000	USD	925.883	932.686	0,27
				<b>17.078.968</b>	<b>17.065.097</b>	<b>4,95</b>
<b>Kazakhstan</b>						
CH0448036266	Nat Kazak 3.25% 18-05.12.23	420.000	CHF	390.090	376.920	0,11
				<b>390.090</b>	<b>376.920</b>	<b>0,11</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS0282506657	Bei 2.15% 07-18.1.27 Senior	150.000.000	JPY	1.399.429	1.477.426	0,43
XS0219724878	Bei 4% 05-15.10.37	1.000.000	EUR	1.210.290	1.642.070	0,48
US298785DV50	Bei 4.875% 06-15.02.36	600.000	USD	585.681	818.100	0,24
XS0110373569	Bei 5.5% 00-15.04.25	500.000	GBP	718.084	696.197	0,20
US298785JB33	Eib 1.625% 20-14.03.25	2.000.000	USD	1.825.229	1.904.926	0,55
				<b>5.738.713</b>	<b>6.538.719</b>	<b>1,90</b>
<b>Mexique</b>						
USP4949BAJ37	Grupo Bimbo 3.875% 14-27.06.24	500.000	USD	426.777	456.136	0,13
				<b>426.777</b>	<b>456.136</b>	<b>0,13</b>
<b>Pays-Bas</b>						
XS1394791492	Abn Amro 1% 16-13.04.31	500.000	EUR	486.225	539.815	0,16
CH0441004402	Achmea Hypo 0.5% 18-15.11.22	150.000	CHF	131.455	141.926	0,04
DE000A28RSR6	Allianz Fin 0.50% 20-14.01.31 Regs	1.000.000	EUR	1.012.376	916.410	0,27
DE000A2RWAY2	Allianz Fin 1.5% 19-15.01.30	1.500.000	EUR	1.675.060	1.526.925	0,44
XS1982834282	Bng 0.875% 19-17.10.35	500.000	EUR	539.340	544.645	0,16
XS0092607497	Bng 5.375% 98-7.6.21 Emtn	100.000	GBP	144.177	119.478	0,03
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	400.000	CHF	355.295	347.103	0,10
XS1991126431	Coop Rabo 1.125% 19-07.05.31	1.500.000	EUR	1.589.125	1.381.395	0,40
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	100.000	EUR	100.000	101.000	0,03
USN4580HAA51	Ing Groe 4.625% 18-06.1.26 Regs	2.000.000	USD	1.924.738	1.918.159	0,55
US456837AP87	Ing Groep 3.55% 19-09.04.24	1.000.000	USD	919.853	910.740	0,26
US60920LAF13	Mondelez In 2.25% 19-19.09.24	500.000	USD	457.174	450.736	0,13
NL0000102317	Netherlands 5.5% 98-15.01.28	300.000	EUR	355.638	439.077	0,13
US21685WDD65	Rabobk 3.875% 12-08.02.22	500.000	USD	470.655	468.772	0,14
XS2049616621	Siemens Fin 0.125% 19-5.9.29	1.000.000	EUR	978.655	907.920	0,26
US879385AD49	Telefonica 8.25% 00-15.9.30	1.100.000	USD	1.422.388	1.397.820	0,41
				<b>12.562.154</b>	<b>12.111.921</b>	<b>3,51</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Norvège</b>						
XS0522030310	Dnb Nor 3.875% 10-29.06.20	1.300.000	EUR	1.320.660	1.311.232	0,38
				<b>1.320.660</b>	<b>1.311.232</b>	<b>0,38</b>
<b>Autriche</b>						
AT0000A10683	Austria 2.4% 13-23.5.34 144a	1.000.000	EUR	1.308.740	1.305.120	0,38
AT0000A0DXC2	Austria 4.85% 09-15.03.26	200.000	EUR	250.716	261.822	0,08
AT0000383864	Austria 6.25% 97-15.07.27	2.500.000	EUR	2.904.825	3.669.450	1,06
				<b>4.464.281</b>	<b>5.236.392</b>	<b>1,52</b>
<b>Philippines</b>						
US045167CW12	Adb 2% 15-22.01.25	2.000.000	USD	1.841.319	1.935.548	0,56
US045167DU47	Adb 2.625% 17-12.01.27	500.000	USD	454.584	509.856	0,15
CH0109156262	Adb 2.75% 10-12.2.30	100.000	CHF	92.324	121.321	0,04
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	210.000.000	JPY	1.921.876	2.110.184	0,61
				<b>4.310.103</b>	<b>4.676.909</b>	<b>1,36</b>
<b>Pologne</b>						
XS1958534528	Poland 1% 19-07.03.29 Regs	1.000.000	EUR	1.020.984	1.061.280	0,31
				<b>1.020.984</b>	<b>1.061.280</b>	<b>0,31</b>
<b>Portugal</b>						
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	100.000	EUR	100.000	103.480	0,03
				<b>100.000</b>	<b>103.480</b>	<b>0,03</b>
<b>Suède</b>						
XS0693812355	Shb 4.375% 11-20.10.2021 Emtn	300.000	EUR	360.840	316.455	0,09
				<b>360.840</b>	<b>316.455</b>	<b>0,09</b>
<b>Suisse</b>						
USH4209UAG16	Ubs Group F 2.859% 17-15.08.23	1.700.000	USD	1.400.567	1.538.173	0,45
CH0341440334	Ubs Grp Fdg 1.5% 16-30.11.24	1.000.000	EUR	1.045.190	980.580	0,28
CH0525158371	Zuerich Ver 0.10% 20-27.08.32	500.000	CHF	472.267	428.580	0,12
				<b>2.918.024</b>	<b>2.947.333</b>	<b>0,85</b>
<b>Espagne</b>						
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	1.500.000	EUR	1.507.761	1.452.330	0,41
ES0200002048	Adif Alta V 0.95% 19-30.04.27	1.000.000	EUR	1.052.190	1.018.790	0,30
XS2079713322	Bbva 0.375% 19-15.11.26	500.000	EUR	497.215	460.650	0,13
XS2013745703	Bbva 1% 19-21.06.26	1.500.000	EUR	1.535.085	1.387.920	0,40
XS1979491559	Ico 0.2% 19-31.01.24	500.000	EUR	499.285	500.745	0,15
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	400.000	EUR	398.344	381.268	0,11
XS1384064587	Santander I 3.25% 16-04.04.26	1.000.000	EUR	1.148.840	996.480	0,29
CH0428194200	Santander 1% 18-10.12.24	500.000	CHF	438.052	450.598	0,13
US05971KAC36	Santander 3.306% 19-27.06.29	600.000	USD	560.043	528.279	0,15
US05964HAF29	Santander 3.8% 17-23.02.28	600.000	USD	524.018	537.542	0,16



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US87938WAP86	Telefonica 5.462% 11-16.2.21	100.000	USD	91.218	92.406	0,03
				<b>8.252.051</b>	<b>7.807.008</b>	<b>2,26</b>
<b>Corée du Sud</b>						
US50064FAR55	Korea 2% 19-19.06.24	1.000.000	USD	926.517	947.113	0,27
XS1999730374	Kr Hous Fin 0.10% 19-18.06.24	645.000	EUR	644.774	647.690	0,19
				<b>1.571.291</b>	<b>1.594.803</b>	<b>0,46</b>
<b>Venezuela</b>						
XS2081543204	Corp An 0.625% 19-20.11.26 Regs	1.500.000	EUR	1.499.591	1.506.765	0,44
XS1943474483	Corp Andina 0.625% 19-30.01.24	700.000	EUR	696.156	701.666	0,20
				<b>2.195.747</b>	<b>2.208.431</b>	<b>0,64</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US00037BAB80	Abb Fin Usa 2.875%12-08.05.22	1.400.000	USD	1.264.761	1.288.957	0,37
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	1.500.000	EUR	1.495.594	1.402.545	0,41
CH0474977722	Bac 0.252% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	891.025	881.180	0,26
XS2038039074	Bac 0.58% 19-08.08.29	1.000.000	EUR	998.930	883.290	0,26
XS1811435251	Bafc 1.662% 18-25.04.28	1.000.000	EUR	1.037.570	977.210	0,28
US06051GGA13	Boa 3.248% 16-21.10.27	1.100.000	USD	995.005	1.047.399	0,30
US17275RAN26	Cisco Sys 3.625% 14-04.03.24	500.000	USD	467.934	495.343	0,14
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	250.000	USD	223.907	215.865	0,06
XS2075937370	Eli Lilly 0.625% 19-01.11.31	1.000.000	EUR	1.015.990	915.410	0,27
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	300.000	EUR	299.877	286.758	0,08
US370334CG79	Gen Mills 4.2% 18-17.04.28	1.000.000	USD	879.877	1.009.697	0,29
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	300.000	USD	269.890	243.658	0,07
US428236BV43	Hp 4.65% 11-09.12.21	1.100.000	USD	1.086.770	1.065.724	0,31
CA458182EA63	Iadb 1.70% 19-10.10.24	500.000	CAD	343.956	329.325	0,10
US4581X0CM87	Iadb 2.125% 15-15.01.25	600.000	USD	548.966	583.174	0,17
US4581X0CC06	Iadb 3% 13-04.10.23	2.500.000	USD	2.196.300	2.465.868	0,72
XS1944456109	Ibm Corp 0.875% 19-31.01.25	1.000.000	EUR	1.019.641	996.880	0,29
US459200KA85	Ibm Corp 3.50% 19-15.05.29	1.500.000	USD	1.467.496	1.491.811	0,43
CA459058HS51	Intl Bk Rec 1.90% 20-16.01.25	700.000	CAD	482.160	464.878	0,13
XS2075811948	Jpm Frn 19-04.11.32	1.500.000	EUR	1.534.465	1.349.865	0,39
US46625HRV41	Jpm 2.95% 16-01.10.26	500.000	USD	474.749	471.196	0,14
US46625HQW33	Jpm 3.3% 16-01.04.26	1.100.000	USD	1.016.552	1.046.657	0,30
US46625HJX98	Jpm 3.625% 14-13.05.24	500.000	USD	456.250	488.248	0,14
US494368CA98	Kimberly-cl 2.875% 20-07.02.50	100.000	USD	90.331	89.722	0,03
XS1493853987	Lafarge 3.5% 16-22.09.26	1.100.000	USD	1.000.910	1.008.040	0,29
US58933YAX31	Merck 3.4% 19-07.03.29	1.000.000	USD	991.081	1.009.032	0,29
US59217GDC06	Met Life 3.05% 19-17.06.29	500.000	USD	480.988	469.455	0,14
US59217HBB24	Met Life 3.45% 16-18.12.26	1.000.000	USD	866.068	958.382	0,28
US594918BJ27	Microsoft 3.125% 15-03.11.25	2.000.000	USD	1.740.095	1.999.890	0,59
XS1197270819	Mondelez 1.625% 15-08.03.27	1.000.000	EUR	1.009.640	1.014.650	0,29
US609207AR65	Mondelez 3.625% 19-13.02.26	500.000	USD	450.615	477.687	0,14
US66989HAD08	Novartis Cap 4.4% 10-24.04.20	500.000	USD	454.681	456.951	0,13
US713448CM83	Pepsico 3.6% 14-01.03.24	400.000	USD	367.539	395.491	0,11
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	1.500.000	EUR	1.490.126	1.259.310	0,37
XS2068969067	Rabobk Ny 0.25% 19-30.10.26	2.000.000	EUR	1.997.064	1.821.759	0,54

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US21688AAE29	Rabobk Ny 3.375% 15-21.05.25	500.000	USD	449.882	480.055	0,14
US87612EBA38	Target Corp 4%12-1.7.42	200.000	USD	139.317	212.568	0,06
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	500.000	USD	456.840	478.000	0,14
US904764AM94	Unilev Cap 4.25% 11-10.02.21	300.000	USD	267.296	279.212	0,08
US92343VCR33	Verizon Com 3.5% 14-01.11.24	1.400.000	USD	1.250.056	1.360.166	0,39
				<b>33.970.194</b>	<b>34.171.308</b>	<b>9,92</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>156.352.620</b>	<b>157.647.881</b>	<b>45,71</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>298.081.724</b>	<b>294.034.387</b>	<b>85,24</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Canada</b>						
CA58458F1018	Medical Intellig Techs Com	290.000	CAD	122.612	0	0,00
				<b>122.612</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>122.612</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Côte d'Ivoire</b>						
US008281BC08	Adb 0.75% 20-03.04.23	800.000	USD	724.681	732.034	0,21
				<b>724.681</b>	<b>732.034</b>	<b>0,21</b>
<b>Canada</b>						
CA12593CAF82	Cppib Capit 3% 18-15.6.28(rest)	1.000.000	CAD	727.397	700.377	0,21
CA6330674V23	Natl Bk 1.957% 17-30.06.22	1.000.000	CAD	685.027	636.957	0,18
CA63306AFX96	Natl Bk 2.983% 19-04.03.24	500.000	CAD	354.697	323.998	0,09
CA68333ZAE75	Ontario 2.7% 18-02.06.29	1.000.000	CAD	710.878	686.324	0,21
CA891160QY28	Tor Dom Bk 3.224% 17-25.07.29	1.000.000	CAD	710.931	634.792	0,18
CA891160RP02	Tor Dom Bk 3.589% 18-14.09.28	500.000	CAD	342.539	323.082	0,09
				<b>3.531.469</b>	<b>3.305.530</b>	<b>0,96</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>4.256.150</b>	<b>4.037.564</b>	<b>1,17</b>
<b>Droits</b>						
<b>Autriche</b>						
AT0000A10BA2	Rights Intercell Ag	42.288	EUR	0	0	0,00
				<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total - Droits</b>				<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0,00</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>4.378.762</b>	<b>4.037.564</b>	<b>1,17</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
	<b>Luxembourg</b>					
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	323.704	USD	31.043.058	26.474.576	7,67
				<b>31.043.058</b>	<b>26.474.576</b>	<b>7,67</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>31.043.058</b>	<b>26.474.576</b>	<b>7,67</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>31.043.058</b>	<b>26.474.576</b>	<b>7,67</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>333.503.544</b>	<b>324.546.527</b>	<b>94,08</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Etats-Unis d'Amérique	33,07	Banques et autres institutions financières	20,48
Luxembourg	10,00	Obligations d'Etats et de villes étrangers	9,24
Canada	7,01	Holdings et sociétés financières	8,16
France	6,33	Fonds d'investissements	7,67
Allemagne	5,98	Electrotechnique, électronique	6,43
Pays-Bas	4,98	Supranational	5,45
Royaume-Uni	4,84	Internet Software	5,21
Japon	3,89	Pharmacie et cosmétique	4,56
Espagne	2,26	Santé, éducation et services sociaux	3,63
Suisse	2,00	Energie et service des eaux	3,19
Irlande	1,96	Transmission de nouvelles	2,90
Australie	1,70	Alimentation, boissons	2,40
Danemark	1,62	Articles de bureau et ordinateurs	2,13
Autriche	1,52	Assurances	1,89
Philippines	1,36	Chimie	1,55
Norvège	0,75	Biens de consommation divers	1,55
Belgique	0,69	Commerce de détail et grands magasins	1,44
Chili	0,64	Services divers	1,38
Venezuela	0,64	Circulation et transport	1,20
Corée du Sud	0,46	Mécanique, outillage	0,93
Israël	0,43	Biotechnologie	0,81
Singapour	0,34	Véhicules routiers	0,77
Pologne	0,31	Arts graphiques et maisons d'édition	0,46
Brésil	0,26	Sociétés immobilières	0,37
Caimans (Iles)	0,25	Construction, matériel de construction	0,25
Côte d'Ivoire	0,21	Papier et bois	0,03
Chine	0,17		<b>94,08</b>
Mexique	0,13		
Kazakhstan	0,11		
Suède	0,09		
Honduras	0,05		
Portugal	0,03		
	<b>94,08</b>		

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0974264930	Ageas Nv	137	EUR	4.427	5.514	0,01
BE0003826436	Telenet Group Holding	213	EUR	10.033	6.205	0,01
BE0003739530	Ucb	124	EUR	12.147	10.400	0,00
				<b>26.607</b>	<b>22.119</b>	<b>0,02</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	216	USD	17.072	12.539	0,01
				<b>17.072</b>	<b>12.539</b>	<b>0,01</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	73	EUR	22.609	15.957	0,01
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	164	EUR	34.842	27.315	0,03
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	72	EUR	8.070	6.753	0,01
DE0005439004	Continental Ag	52	EUR	3.694	3.622	0,00
DE0006062144	Covestro Ag	94	EUR	2.902	2.781	0,00
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	462	EUR	3.150	2.928	0,00
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	107	EUR	15.212	14.200	0,01
DE0005552004	Deutsche Post Ag	419	EUR	14.971	11.021	0,01
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	996	EUR	12.657	12.492	0,01
DE000ENAG999	E.on Se	225	EUR	2.113	2.255	0,00
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-	347	EUR	9.784	7.025	0,01
DE0006048432	Henkel / Vorzug	154	EUR	15.209	11.968	0,01
DE0006231004	Infineon Technologies /nam.	135	EUR	2.002	1.925	0,00
DE000KGX8881	Kion Group	62	EUR	2.621	2.596	0,00
DE0005470405	Lanxess Ag	111	EUR	4.189	4.292	0,00
DE0006599905	Merck Kgaa	38	EUR	3.749	3.777	0,00
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	74	EUR	16.232	14.463	0,01
DE0006969603	Puma Se	117	EUR	8.606	6.757	0,01
DE0007164600	Sap Se	230	EUR	24.022	25.102	0,03
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	315	EUR	36.861	25.907	0,03
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	2.974	EUR	11.650	7.132	0,01
DE000UNSE018	Uniper Se	272	EUR	7.867	6.494	0,01
				<b>263.012</b>	<b>216.762</b>	<b>0,20</b>
<b>Finlande</b>						
FI0009007132	Fortum Corporation	377	EUR	5.259	5.353	0,00
FI0009007835	Metso Corp	434	EUR	14.088	10.009	0,02
FI0009000681	Nokia Oy	1.644	EUR	4.956	5.007	0,00
FI0009014377	Orion Corp (new)- Shs-b-	108	EUR	4.408	4.274	0,00
				<b>28.711</b>	<b>24.643</b>	<b>0,02</b>
<b>France</b>						
FR0000120073	Air Liquide	103	EUR	12.523	12.756	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000120628	Axa	1.011	EUR	26.248	16.946	0,02
FR0000131104	Bnp Paribas	377	EUR	12.023	11.011	0,01
FR0000039299	Bollore Sa	1.713	EUR	7.079	4.565	0,00
FR0000120503	Bouygues	274	EUR	11.626	7.773	0,01
FR0000125338	Capgemini Se	36	EUR	2.776	2.943	0,00
FR0000120222	Cnp Assurances	432	EUR	8.524	4.091	0,00
FR0000120644	Danone.	178	EUR	10.620	11.081	0,01
FR0000130452	Eiffage Sa	163	EUR	17.927	11.162	0,01
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	124	EUR	18.668	12.938	0,01
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	848	EUR	20.078	8.576	0,01
FR0000052292	Hermes International	18	EUR	13.411	12.016	0,01
FR0000121485	Kering Sa	32	EUR	20.129	16.168	0,01
FR0000120321	L Oreal	87	EUR	25.294	22.065	0,02
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	110	EUR	6.743	6.829	0,01
FR0000121261	Michelin B /nom.	98	EUR	8.372	8.434	0,01
FR0000125007	Saint-gobain	479	EUR	17.230	11.272	0,01
FR0000120578	Sanofi	353	EUR	29.970	30.032	0,03
FR0000121972	Schneider Electric Se	222	EUR	24.321	18.520	0,02
FR0000130809	Ste Gen.paris -a-	176	EUR	3.237	2.868	0,00
FR0010613471	Suez Environnement Cie	967	EUR	12.643	9.523	0,01
FR0000120271	Total Sa	853	EUR	47.031	32.048	0,03
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	29	EUR	1.923	2.068	0,00
FR0000124141	Veolia Environnement	473	EUR	11.843	9.780	0,01
FR0000125486	Vinci.	134	EUR	13.587	10.726	0,01
				<b>383.826</b>	<b>296.191</b>	<b>0,27</b>
	<b>Irlande</b>					
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	52	USD	9.587	8.214	0,01
IE00BY9D5467	Allergan Plc	18	USD	2.976	3.084	0,00
IE00BD1RP616	Bank Of Ireland Group Plc	1.033	EUR	2.167	1.891	0,00
IE0001827041	Crh Plc	340	EUR	11.047	8.970	0,01
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	119	USD	9.125	8.945	0,01
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	377	USD	14.629	9.834	0,00
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	110	USD	9.868	9.598	0,01
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	235	EUR	7.613	6.417	0,01
				<b>67.012</b>	<b>56.953</b>	<b>0,05</b>
	<b>Italie</b>					
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	250	EUR	4.764	3.294	0,00
IT0003128367	Enel	2.773	EUR	15.757	18.661	0,03
IT0003132476	Eni Spa Roma	1.589	EUR	27.625	15.554	0,01
NL0011585146	Ferrari N.v.	54	EUR	8.007	8.115	0,01
IT0003828271	Recordati Ind Chimica/post Rag	52	EUR	2.123	2.128	0,00
IT0005239360	Unicredit Spa	285	EUR	2.550	2.162	0,00
				<b>60.826</b>	<b>49.914</b>	<b>0,05</b>
	<b>Japon</b>					
JP3122400009	Advantest Corp.	200	JPY	9.835	7.779	0,01
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	200	JPY	5.005	4.775	0,00

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	300	JPY	4.925	5.406	0,00
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	1.079	JPY	16.047	16.160	0,01
JP3220580009	Calbee Inc	100	JPY	2.428	2.618	0,00
JP3242800005	Canon Inc.	500	JPY	10.883	10.571	0,01
JP3566800003	Central Japan Railway Co	100	JPY	15.936	15.523	0,01
JP3511800009	Chiba Bank	1.800	JPY	9.866	7.631	0,01
JP3293200006	Coca-cola Jp H Registered Shs	100	JPY	1.932	1.989	0,00
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	400	JPY	10.284	8.249	0,01
JP3485800001	Daicel --- Shs	1.100	JPY	11.424	7.779	0,01
JP3475350009	Daiichi Sankyo Co Ltd	100	JPY	6.343	6.663	0,01
JP3551500006	Denso Corp	500	JPY	20.221	15.644	0,01
JP3160400002	Eisai Co.ltd	200	JPY	14.404	14.216	0,01
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	500	JPY	8.776	8.685	0,01
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	400	JPY	12.275	8.780	0,01
JP3818000006	Fujitsu Ltd	100	JPY	7.858	8.743	0,01
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	400	JPY	4.085	3.908	0,00
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	100	JPY	5.929	7.152	0,01
JP3788600009	Hitachi Ltd	700	JPY	23.752	19.718	0,02
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	600	JPY	13.666	13.067	0,01
JP3837800006	Hoya Corp	100	JPY	7.884	8.246	0,01
JP3294460005	Inpex Corp	1.000	JPY	9.704	5.456	0,00
JP3143900003	Itochu Techno-solutions	300	JPY	7.906	8.295	0,01
JP3705200008	Japan Air Lines Co Jpy50	200	JPY	3.798	3.567	0,00
JP3386030005	Jfe Holdings Inc	300	JPY	2.228	1.890	0,00
JP3292200007	Jtekt Corp	300	JPY	2.163	1.976	0,00
JP3205800000	Kao Corp.	200	JPY	16.339	15.828	0,01
JP3496400007	Kddi Corp.	800	JPY	23.205	22.872	0,03
JP3266400005	Kubota Corp	300	JPY	3.465	3.715	0,00
JP3256000005	Kyowa Kirin Rg Registered Shs	400	JPY	9.502	8.683	0,01
JP3982100004	Lawson Inc	142	JPY	8.337	7.547	0,01
JP3626800001	Lixil Group Shs	900	JPY	14.935	10.849	0,01
JP3750500005	Mcdonald S Holdings Co (japan)	100	JPY	4.390	4.365	0,00
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	600	JPY	3.580	3.457	0,00
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	900	JPY	13.395	12.866	0,01
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	1.500	JPY	9.009	7.152	0,01
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	400	JPY	6.796	6.706	0,01
JP3885780001	Mizuho Financial Groupinc	7.400	JPY	8.759	8.197	0,01
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	500	JPY	15.914	13.556	0,01
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	200	JPY	9.676	9.809	0,01
JP3651210001	Nabtesco Corp	100	JPY	2.243	2.236	0,00
JP3733000008	Nec Corp	300	JPY	11.888	10.607	0,01
JP3758190007	Nexon Co Ltd	200	JPY	2.954	3.164	0,00
JP3695200000	Ngk Insulators Ltd	200	JPY	2.678	2.540	0,00
JP3729400006	Nippon Express Co.ltd	100	JPY	5.955	4.741	0,00
JP3743000006	Nippon Meat Packers	200	JPY	8.502	6.749	0,01
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co.ltd.	100	JPY	5.122	5.073	0,00
JP3735400008	Nippon Tel&tel	700	JPY	17.034	16.158	0,01
JP3672400003	Nissan Motor Co.ltd	700	JPY	2.465	2.237	0,00
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	300	JPY	4.626	4.845	0,00
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	200	JPY	11.302	8.649	0,01



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	700	JPY	14.160	11.010	0,01
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	600	JPY	14.906	18.160	0,02
JP3190000004	Obayashi Corp.	1.145	JPY	12.011	9.503	0,01
JP3201200007	Olympus Corp	800	JPY	9.368	11.200	0,01
JP3197600004	Ono Pharmaceutical Co	100	JPY	2.007	2.228	0,00
JP3200450009	Orix Corp	900	JPY	15.187	10.490	0,01
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	100	JPY	3.468	3.792	0,00
JP3866800000	Panasonic Corp	600	JPY	4.441	4.436	0,00
JP3547670004	Persol Holdings Co. Ltd.	200	JPY	1.925	1.947	0,00
JP3855900001	Pola Orbis Holdings Inc	100	JPY	1.813	1.788	0,00
JP3970300004	Recruit Holdings Co.ltd.	300	JPY	8.184	7.518	0,01
JP3973400009	Ricoh Co.ltd	1.700	JPY	16.556	12.098	0,01
JP3336000009	Santen Pharmaceutical	100	JPY	1.718	1.665	0,00
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	1.000	JPY	17.120	12.843	0,01
JP3420600003	Sekisui House Ltd	500	JPY	8.930	7.997	0,01
JP3422950000	Seven & I Holdings Co Ltd	300	JPY	11.633	9.615	0,01
JP3162770006	Sg Holdings Co. Ltd.	100	JPY	2.142	2.306	0,00
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	200	JPY	18.845	19.234	0,02
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	100	JPY	4.423	4.765	0,00
JP3732000009	Softbank Corp.	300	JPY	3.738	3.696	0,00
JP3435000009	Sony Corp	500	JPY	31.959	28.774	0,04
JP3399400005	Stanley Electric Co Ltd	100	JPY	1.922	1.911	0,00
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	1.600	JPY	4.622	4.603	0,00
JP3407400005	Sumitomo Electric Industries	200	JPY	2.056	2.040	0,00
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	300	JPY	9.397	7.053	0,01
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	300	JPY	10.795	8.400	0,01
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	300	JPY	7.758	9.303	0,01
JP3336560002	Suntory B & F	200	JPY	7.182	7.322	0,01
JP3443600006	Taisei Corp.	300	JPY	11.417	8.886	0,01
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	300	JPY	8.811	8.894	0,01
JP3539220008	T&d Holdings Inc Tokyo	1.400	JPY	17.686	11.092	0,01
JP3544000007	Teijin Ltd	500	JPY	9.524	8.201	0,01
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	300	JPY	16.122	13.309	0,01
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	100	JPY	19.779	18.243	0,02
JP3573000001	Tokyo Gas Co.ltd *opr*	100	JPY	2.116	2.291	0,00
JP3629000005	Toppan Printing Co.ltd	300	JPY	5.337	4.453	0,00
JP3592200004	Toshiba Corp	300	JPY	6.580	6.399	0,01
JP3595200001	Tosoh Corp	500	JPY	6.985	5.512	0,01
JP3634200004	Toyoda Gosei Co Ltd	200	JPY	4.744	3.323	0,00
JP3633400001	Toyota Motor Corp	742	JPY	46.302	43.232	0,05
JP3659000008	West Japan Railway Co	100	JPY	7.516	6.629	0,01
JP3933800009	Z Holdings Corporation	2.600	JPY	7.850	8.109	0,01
				<b>890.663</b>	<b>801.357</b>	<b>0,73</b>
	<b>Canada</b>					
CA94106B1013	Waste Connections Inc	34	USD	2.378	2.550	0,00
				<b>2.378</b>	<b>2.550</b>	<b>0,00</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Liechtenstein</b>						
LI0355147575	Liechtenst	804	CHF	55.494	43.416	0,04
				<b>55.494</b>	<b>43.416</b>	<b>0,04</b>
<b>Pays-Bas</b>						
NL0012969182	Adyen B.v.	6	EUR	4.678	4.909	0,00
NL0000687663	Aercap Holdings Nv	141	USD	8.666	3.109	0,00
NL0013267909	Akzo Nobel	96	EUR	5.715	6.116	0,01
NL0010273215	Asml Holding Nv	103	EUR	22.252	26.511	0,03
NL0012059018	Exor N.v.	182	EUR	8.966	9.081	0,01
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.v	287	EUR	2.079	2.002	0,00
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.v.	23	EUR	1.713	1.678	0,00
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	531	EUR	11.773	11.999	0,01
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	1.200	EUR	3.499	2.772	0,00
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	412	EUR	16.009	16.147	0,02
NL0009538784	Nxp Semiconductor	33	USD	3.550	2.648	0,00
NL0013654783	Prosus Bearer Rg Shs -n-	39	EUR	2.635	2.615	0,00
NL0000379121	Randstad Holding (eur 0.1)	148	EUR	4.944	5.055	0,00
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	152	EUR	2.973	3.207	0,00
NL0000388619	Unilever Nv.	489	EUR	27.625	23.260	0,03
				<b>127.077</b>	<b>121.109</b>	<b>0,11</b>
<b>Autriche</b>						
AT0000652011	Erste Group Bank Ag	113	EUR	2.307	2.026	0,00
				<b>2.307</b>	<b>2.026</b>	<b>0,00</b>
<b>Portugal</b>						
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	1.513	EUR	5.438	5.876	0,01
				<b>5.438</b>	<b>5.876</b>	<b>0,01</b>
<b>Suisse</b>						
CH0012221716	Abb	18.240	CHF	419.723	310.171	0,28
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	3.324	CHF	234.553	126.777	0,12
CH0432492467	Alcon Inc.	2.855	CHF	134.217	140.837	0,13
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	5.080	CHF	73.007	27.686	0,03
CH0012410517	Baloise Holding/namen	1.139	CHF	170.403	144.539	0,13
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	57	CHF	104.483	110.580	0,10
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	24	CHF	126.738	150.240	0,14
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	30.635	CHF	523.746	245.080	0,22
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	113	CHF	143.538	75.597	0,07
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	82	CHF	133.246	96.022	0,09
CH0114405324	Garmin	107	USD	10.054	7.760	0,01
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	451	CHF	197.999	192.126	0,17
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	60	CHF	129.666	179.700	0,16
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	65	CHF	72.578	74.880	0,07
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	133	CHF	76.012	83.790	0,08
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	4.851	CHF	256.045	171.531	0,16
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	1.107	CHF	76.777	73.726	0,07

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0038863350	Nestle / Act Nom	18.067	CHF	1.382.187	1.796.764	1,63
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	18.054	CHF	1.239.996	1.441.612	1,30
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	5.581	CHF	1.226.760	1.752.714	1,59
CH0024638196	Schindler Holding/partic	811	CHF	171.941	172.256	0,16
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	72	CHF	71.294	67.608	0,06
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	11.917	CHF	123.184	172.558	0,16
CH0418792922	Sika Ltd	946	CHF	120.621	151.313	0,14
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	955	CHF	149.467	166.552	0,15
CH0002178181	Stadler Rail Ag	869	CHF	33.022	38.844	0,04
CH0126881561	Swiss Re-namen	4.627	CHF	448.471	344.989	0,31
CH0008742519	Swisscom /nam.	520	CHF	264.069	270.504	0,25
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	1.378	CHF	104.527	52.474	0,05
CH0244767585	Ubs Group Ag	40.421	CHF	692.749	365.648	0,32
CH0311864901	Vat Group Ltd	617	CHF	73.377	82.678	0,08
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	147	CHF	8.373	6.997	0,01
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	1.545	CHF	485.463	530.553	0,47
				<b>9.478.286</b>	<b>9.625.106</b>	<b>8,75</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0105046009	Aena Sme Sa	87	EUR	16.402	9.192	0,01
ES0113900J37	Banco Santander --- Reg.shs	974	EUR	2.553	2.294	0,00
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	3.323	EUR	11.494	10.285	0,01
ES0130670112	Endesa Sa	272	EUR	7.057	5.622	0,01
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	2.072	EUR	19.352	19.763	0,02
ES0148396007	Inditex	534	EUR	15.644	13.413	0,01
ES0173516115	Repsol Sa	1.310	EUR	18.895	11.588	0,01
				<b>91.397</b>	<b>72.157</b>	<b>0,07</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	144	USD	8.632	10.994	0,01
US00287Y1091	Abbvie Inc	77	USD	6.670	5.676	0,01
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	58	USD	4.121	5.134	0,00
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	12	USD	12.935	13.491	0,01
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	13	USD	14.228	14.626	0,01
US0231351067	Amazon Com Inc	16	USD	26.837	30.183	0,04
US0258161092	American Express Co.	144	USD	14.636	11.928	0,01
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	32	USD	5.141	3.173	0,00
US0311621009	Amgen Inc	69	USD	13.151	13.534	0,01
US0378331005	Apple Inc	176	USD	33.761	43.302	0,05
US0382221051	Applied Materials Inc	173	USD	10.545	7.670	0,01
US03965L1008	Arconic Inc	241	USD	5.384	3.745	0,00
US00206R1023	At & T	508	USD	15.875	14.328	0,01
US0718131099	Baxter Intl Inc	27	USD	2.025	2.121	0,00
US0865161014	Best Buy Co Inc.	64	USD	4.455	3.530	0,00
US09062X1037	Biogen Inc	8	USD	2.231	2.449	0,00
US1011371077	Boston Scientific Corp.	88	USD	2.576	2.778	0,00
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	116	USD	5.601	6.256	0,01
US1273871087	Cadence Design Systems	118	USD	7.017	7.540	0,01
US1567821046	Cerner Corp	104	USD	6.987	6.338	0,01
US1667641005	Chevron Corporation	59	USD	3.999	4.136	0,00

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	307	USD	13.267	11.677	0,01
US1729674242	Citigroup Inc	318	USD	20.410	12.960	0,01
US1746101054	Citizens Financial Group Inc	440	USD	15.350	8.008	0,01
US1912161007	Coca-cola Co.	327	USD	16.134	14.000	0,01
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	30	USD	1.758	1.926	0,00
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	57	USD	1.872	1.896	0,00
US20825C1045	Conocophillips	82	USD	2.482	2.444	0,00
US2310211063	Cummins Inc	50	USD	7.156	6.546	0,01
US2600031080	Dover Corp.	102	USD	9.261	8.284	0,01
US26441C2044	Duke Energy	61	USD	4.459	4.774	0,00
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	690	USD	16.029	9.647	0,01
US30303M1027	Facebook Inc -a-	92	USD	14.459	14.848	0,01
US3156161024	F5 Networks Inc.	66	USD	8.611	6.809	0,01
US3696041033	General Electric Co	399	USD	2.951	3.065	0,00
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	39	USD	2.658	2.821	0,00
US37959E1029	Globe Life Inc	160	USD	13.114	11.142	0,01
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	17	USD	2.580	2.543	0,00
US4364401012	Hologic Inc	49	USD	1.547	1.664	0,00
US4370761029	Home Depot Inc.	34	USD	6.047	6.142	0,01
US4592001014	Ibm Corp	54	USD	5.593	5.796	0,01
US4581401001	Intel Corp.	94	USD	4.715	4.922	0,00
US4612021034	Intuit	17	USD	3.869	3.783	0,00
US4781601046	Johnson & Johnson	154	USD	17.990	19.539	0,03
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	85	USD	11.935	8.305	0,01
US4943681035	Kimberly Clark Corp	70	USD	8.974	8.660	0,01
US5002551043	Kohl S Corp.	267	USD	15.622	3.769	0,00
US5010441013	Kroger Co.	50	USD	1.367	1.457	0,00
US5128071082	Lam Research Corp	34	USD	8.895	7.895	0,01
US5312294094	Liberty Media Corp	205	USD	10.244	6.286	0,01
US5324571083	Lilly (eli) & Co	30	USD	3.579	4.027	0,00
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	36	USD	9.054	8.414	0,01
US58933Y1055	Merck	189	USD	14.606	14.070	0,01
US59156R1086	Metlife Inc	330	USD	14.829	9.761	0,01
US5949181045	Microsoft Corp.	319	USD	28.800	48.676	0,05
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	92	USD	4.151	4.458	0,00
US61174X1090	Monster Beverage Corp	144	USD	9.961	7.839	0,01
US6153691059	Moody S Corp	11	USD	2.229	2.251	0,00
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	16	USD	2.092	2.058	0,00
US6541061031	Nike Inc B	71	USD	5.489	5.684	0,01
US65473P1057	Nisource Inc	190	USD	4.244	4.590	0,00
US67066G1040	Nvidia Corp.	25	USD	6.008	6.376	0,01
US6907421019	Owens Corning Inc	260	USD	16.767	9.763	0,01
US7010941042	Parker-hannifin	33	USD	4.086	4.142	0,00
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	25	USD	2.341	2.316	0,00
US7134481081	Pepsico Inc	29	USD	3.192	3.370	0,00
US7170811035	Pfizer Inc.	176	USD	5.123	5.558	0,01
US7512121010	Polo Ralph Lauren	54	USD	5.594	3.492	0,00
US6935061076	Ppg Industries Inc.	45	USD	3.774	3.640	0,00
US69351T1060	Ppl Corp	213	USD	4.633	5.086	0,00
US7458671010	Pultegroup Inc	373	USD	14.189	8.055	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US74736K1016	Qorvo Inc	39	USD	3.681	3.043	0,00
US7475251036	Qualcomm Inc.	122	USD	10.799	7.985	0,01
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	4	USD	1.682	1.890	0,00
US7591EP1005	Regions Financial Corp	1.069	USD	19.792	9.278	0,01
US7607591002	Republic Services Inc.	102	USD	6.670	7.408	0,01
US79466L3024	Salesforce Com Inc	16	USD	2.302	2.229	0,00
US78409V1044	S&p Global Shs	41	USD	10.738	9.721	0,01
US87165B1035	Synchrony Financial	224	USD	7.048	3.487	0,00
US8716071076	Synopsys Inc.	18	USD	2.137	2.243	0,00
US8718291078	Sysco Corp.	217	USD	15.265	9.580	0,01
US87612E1064	Target Corp	70	USD	4.704	6.297	0,01
US8725401090	Tjx Companies Inc	98	USD	5.733	4.533	0,00
US89400J1079	Transunion	48	USD	3.089	3.074	0,00
US9024941034	Tyson Foods Inc.-a-	52	USD	3.959	2.912	0,00
US9078181081	Union Pacific Corp.	37	USD	4.812	5.049	0,00
US9113631090	United Rentals Inc.	34	USD	5.169	3.385	0,00
US9130171096	United Technologies Corp	112	USD	10.541	10.222	0,01
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	63	USD	13.794	15.201	0,01
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	12	USD	2.467	2.763	0,00
US92826C8394	Visa Inc -a	109	USD	18.005	16.992	0,03
US9297401088	Wabtec Corp	40	USD	1.828	1.863	0,00
US9633201069	Whirlpool Corp.	87	USD	13.667	7.222	0,01
US3848021040	Ww Grainger Inc	24	USD	7.895	5.770	0,01
US9884981013	Yum Brands Shs	55	USD	3.921	3.647	0,00
				<b>800.595</b>	<b>723.960</b>	<b>0,66</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>12.300.701</b>	<b>12.076.678</b>	<b>10,99</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
CH0512502995	Cw Bk Austr 0.113% 19-10.12.29	500.000	CHF	500.000	453.625	0,41
CH0340912168	Transurban 0.65% 16-02.11.26	1.250.000	CHF	1.193.810	1.152.812	1,05
CH0417086060	Westpac Bk 0.4% 18-06.06.24	1.000.000	CHF	1.002.450	981.500	0,89
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	100.000	USD	97.252	96.531	0,09
				<b>2.793.512</b>	<b>2.684.468</b>	<b>2,44</b>
<b>Chili</b>						
CH0496632628	Bc Sant Cl 0.135% 19-29.08.29	1.000.000	CHF	999.000	790.000	0,72
CH0479222066	Bco Dest Cl 0.24% 19-06.06.25	500.000	CHF	500.000	442.000	0,40
CH0506071239	Credito 0.10% 20-18.09.26	500.000	CHF	500.040	441.500	0,40
CH0505011889	Credito 0.25% 19-29.10.25	500.000	CHF	500.075	452.500	0,41
				<b>2.499.115</b>	<b>2.126.000</b>	<b>1,93</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	600.000	USD	606.505	619.414	0,56
				<b>606.505</b>	<b>619.414</b>	<b>0,56</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Danemark</b>						
CH0026985520	Kommkrdt 2.875% 06-13.10.31	1.000.000	CHF	1.013.400	1.319.500	1,20
				<b>1.013.400</b>	<b>1.319.500</b>	<b>1,20</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A11QSB8	Daimler 1.875% 14-08.07.24	1.000.000	EUR	1.102.427	1.060.266	0,96
CH0399198396	Deutsche Bk 0.625% 18-08.02.23	1.000.000	CHF	998.050	942.000	0,86
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	700.000	USD	691.923	722.128	0,66
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	500.000	EUR	538.143	504.610	0,46
				<b>3.330.543</b>	<b>3.229.004</b>	<b>2,94</b>
<b>France</b>						
FR0012300820	Arrfp 1.125% 14-15.01.21	1.000.000	EUR	1.198.805	1.063.291	0,97
CH0479514264	Bfcm 0.2% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	1.000.170	967.750	0,88
XS1139080250	Bnpp 4.375% 14-18.11.21	1.000.000	AUD	828.986	622.219	0,57
XS0144628053	Sncf 5.375% 02-18.03.27	400.000	GBP	999.045	619.484	0,56
				<b>4.027.006</b>	<b>3.272.744</b>	<b>2,98</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS1143486865	Astrazeneca 0.875% 14-24.11.21	1.000.000	EUR	1.197.059	1.059.777	0,96
CH0426621683	Barclays 1.125% 18-12.07.23	1.000.000	CHF	1.004.550	987.500	0,90
XS1695301900	Barclays 2.375% 17-06.10.23	1.000.000	GBP	1.298.905	1.165.186	1,07
CH0461239094	Bnz Intl Ln 0.111% 20-24.07.28	200.000	CHF	200.000	186.850	0,17
CH0429659607	Lloyds Bk 1% 18-04.03.25	1.000.000	CHF	999.650	958.000	0,87
CH0488506699	Natwest Mar 0.125% 19-13.09.23	1.000.000	CHF	1.000.900	951.500	0,87
XS2002491517	Natwest Mar 1% 19-28.05.24	1.000.000	EUR	1.115.082	1.009.964	0,92
US80283LAJ26	Santander 4% 14-13.03.24	1.000.000	USD	926.791	999.750	0,91
				<b>7.742.937</b>	<b>7.318.527</b>	<b>6,67</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott II F 0.375% 19-19.11.27	150.000	EUR	161.887	147.076	0,13
				<b>161.887</b>	<b>147.076</b>	<b>0,13</b>
<b>Japon</b>						
XS0257403278	Dbj 2.3% 06-19.03.26	300.000.000	JPY	3.328.746	3.057.255	2,78
				<b>3.328.746</b>	<b>3.057.255</b>	<b>2,78</b>
<b>Canada</b>						
CA07813ZAP95	Bell Canada 7.3% 02-23.2.32m14	1.000.000	CAD	1.059.290	917.771	0,84
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	50.000	USD	48.901	42.217	0,04
CA68323AAD69	Ontario 4%11-02.06.21	1.500.000	CAD	1.158.941	1.058.208	0,95
US748149AQ48	Quebec Prov 2.5% 19-09.04.24 Sr Qw	300.000	USD	298.840	309.228	0,28
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	1.000.000	EUR	1.114.733	1.008.085	0,92
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	1.000.000	USD	997.957	988.275	0,90
CA891145T792	Td Bk 3.226% 14-24.07.24	1.000.000	CAD	870.906	712.875	0,65
US89114QCD88	Tor Dom Bk 1.90% 19-01.12.22	1.000.000	USD	988.703	973.752	0,89
				<b>6.538.271</b>	<b>6.010.411</b>	<b>5,47</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Luxembourg</b>						
XS0282506657	Bei 2.15% 07-18.1.27 Senior	150.000.000	JPY	1.846.339	1.568.502	1,43
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	200.000	EUR	221.340	194.952	0,18
				<b>2.067.679</b>	<b>1.763.454</b>	<b>1,61</b>
<b>Mexique</b>						
US191241AH15	Coca Co F 2.75% 20-22.01.30	150.000	USD	144.064	141.610	0,13
				<b>144.064</b>	<b>141.610</b>	<b>0,13</b>
<b>Pays-Bas</b>						
DE000A28RSR6	Allianz Fin 0.50% 20-14.01.31 Regs	300.000	EUR	322.452	291.871	0,27
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	2.000.000	CHF	2.002.500	1.842.500	1,68
XS0161488498	Deutsch.telek.7.5% 03- 24.01.33	500.000	EUR	911.421	862.178	0,78
XS0452187916	Enel Fin 5% 09-14.9.22	1.000.000	EUR	1.295.297	1.169.774	1,06
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	200.000	EUR	228.200	214.452	0,20
CH0026620846	Rabobk 3.125% 06-15.09.26	2.000.000	CHF	2.265.161	2.274.499	2,06
XS2049616621	Siemens Fin 0.125% 19-5.9.29	200.000	EUR	216.791	192.778	0,18
				<b>7.241.822</b>	<b>6.848.052</b>	<b>6,23</b>
<b>Nigéria</b>						
CH0511762038	Africa Fina 0.522% 19-20.12.23	500.000	CHF	500.000	471.250	0,43
				<b>500.000</b>	<b>471.250</b>	<b>0,43</b>
<b>Philippines</b>						
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	200.000.000	JPY	2.390.398	2.133.585	1,94
				<b>2.390.398</b>	<b>2.133.585</b>	<b>1,94</b>
<b>Suède</b>						
XS0191154961	Vattenf Tsy 5.375% 04-29.04.24	1.000.000	EUR	1.552.209	1.254.631	1,14
				<b>1.552.209</b>	<b>1.254.631</b>	<b>1,14</b>
<b>Suisse</b>						
CH0506668869	Ubs Group F 3% 19-perp	200.000	CHF	200.000	178.500	0,16
CH0525158371	Zuerich Ver 0.10% 20-27.08.32	500.000	CHF	502.180	455.000	0,42
				<b>702.180</b>	<b>633.500</b>	<b>0,58</b>
<b>Espagne</b>						
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	300.000	EUR	320.945	308.372	0,28
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	400.000	EUR	444.730	404.771	0,37
CH0438965540	Santan Cons 0.625% 18-24.10.22	1.000.000	CHF	1.000.989	972.250	0,88
				<b>1.766.664</b>	<b>1.685.393</b>	<b>1,53</b>
<b>Corée du Sud</b>						
CH0506668851	Eibk 0% 19-27.05.25	1.000.000	CHF	1.007.390	955.000	0,87
CH0419040917	Hyucap 0.7325% 19-26.02.24	2.000.000	CHF	2.000.000	1.958.500	1,78
CH0461238856	Kor Railrd 0.0% 19-19.11.24	500.000	CHF	504.525	489.625	0,45
				<b>3.511.915</b>	<b>3.403.125</b>	<b>3,10</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	100.000	EUR	109.061	99.267	0,09
US037833DN70	Apple Inc 2.05% 19-11.09.26	100.000	USD	97.969	99.453	0,09
CH0474977722	Bac 0.252% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	1.000.000	935.500	0,85
US059438AK79	Banc One 8% 97-29.4.27	1.500.000	USD	2.400.227	1.851.637	1,69
US17275RAN26	Cisco Sys 3.625% 14-04.03.24	500.000	USD	528.874	525.878	0,48
CH0365501474	Citigp 0.5% 17-22.11.24	2.900.000	CHF	2.919.846	2.801.400	2,56
CH0297974898	Coca Cola 1% 15-02.10.28	3.000.000	CHF	3.179.500	3.140.999	2,87
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	250.000	USD	238.367	229.172	0,21
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	150.000	EUR	162.351	152.218	0,14
CH0417086045	Gs 1% 18-24.11.25 -h- Regs	1.000.000	CHF	1.006.550	952.250	0,87
US428236BQ57	Hp 4.375% 11-15.9.21	500.000	USD	475.004	492.019	0,45
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	1.000.000	USD	1.163.378	1.417.993	1,29
XS0121569957	Ibrd 5.25% 00-7.6.21	300.000	GBP	534.791	380.019	0,35
US459056LD78	Ibrd 7.625% 93-19.01.23	1.000.000	USD	1.594.815	1.156.542	1,05
AU3CB0224491	Intl Fin 4% 14-03.04.25	1.000.000	AUD	838.532	674.426	0,61
CH0517825268	Jackson Nat 0.125% 20-14.07.28	400.000	CHF	400.340	360.100	0,33
XS1174469137	Jpmorgan Ch 1.5% 15-27.01.25	1.000.000	EUR	989.936	1.056.093	0,96
CH0338330456	Mcdonalds 0.17% 16-04.10.24	1.500.000	CHF	1.494.825	1.477.125	1,34
CH0482172340	Met Life 0.125% 19-11.06.27	1.000.000	CHF	1.000.000	950.250	0,86
XS1110874820	Met Life 1.25% 14-17.09.21	1.000.000	EUR	1.013.268	1.061.730	0,97
US61746BED47	Mor St 2.625% 16-17.11.21	1.000.000	USD	1.002.611	969.427	0,88
US61747WAF68	Mor St 5.75% 11-25.1.2021	1.000.000	USD	1.054.566	993.790	0,90
CH0471297959	Ny Life Gbl 0.25% 19-18.10.27 Regs	2.000.000	CHF	2.006.960	1.917.000	1,74
XS1031555094	Prologis 3.375% 14-20.02.24	1.000.000	EUR	1.353.407	1.153.361	1,05
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	200.000	EUR	217.931	178.259	0,16
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	150.000	USD	147.710	152.240	0,14
US9128283R96	Usa 0.5% 18-15.01.28 /infl	2.000.000	USD	1.829.963	2.117.360	1,93
XS1030900242	Verizon Com 3.25% 14-17.02.26	1.000.000	EUR	1.308.046	1.168.733	1,06
CH0367206668	Verizon 0.375% 17-31.05.23 Regs	1.000.000	CHF	1.005.050	990.750	0,90
				<b>31.073.878</b>	<b>29.454.991</b>	<b>26,82</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>82.992.731</b>	<b>77.573.990</b>	<b>70,61</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>Japon</b>						
JP3569200003	Tokyu Fudos Hldg Crp/reit	1.200	JPY	8.224	5.571	0,01
				<b>8.224</b>	<b>5.571</b>	<b>0,01</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US22822V1017	Crown Castle International Shs	80	USD	11.373	11.177	0,00
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	373	USD	11.550	8.589	0,01
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	22	USD	2.837	2.193	0,00
US6819361006	Omega Healthcare Investors	352	USD	14.028	9.039	0,01
US8666741041	Sun Communities Inc	22	USD	3.246	2.658	0,00
US92276F1003	Ventas Inc.	212	USD	13.495	5.497	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	240	USD	3.623	3.864	0,00
				<b>60.152</b>	<b>43.017</b>	<b>0,03</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>68.376</b>	<b>48.588</b>	<b>0,04</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>95.361.808</b>	<b>89.699.256</b>	<b>81,64</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
CA1107098X34	Bc 3.7% 10-18.12.2020	1.000.000	CAD	762.215	694.494	0,63
CA563469UE37	Manitoba 2.45% 15-02.06.25	1.000.000	CAD	806.633	709.598	0,65
				<b>1.568.848</b>	<b>1.404.092</b>	<b>1,28</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
USU52932BB29	Liberty Mut 4.569% 19-01.02.29	1.000.000	USD	961.334	1.069.093	0,97
				<b>961.334</b>	<b>1.069.093</b>	<b>0,97</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>2.530.182</b>	<b>2.473.185</b>	<b>2,25</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>2.530.182</b>	<b>2.473.185</b>	<b>2,25</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00BVXBYN70	Gam St Chf -ins- /cap	384.604	CHF	3.835.883	4.036.418	3,67
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	185.587	USD	1.251.202	1.193.208	1,09
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	75.472	USD	3.579.232	3.465.670	3,15
				<b>8.666.317</b>	<b>8.695.296</b>	<b>7,91</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	16.369	USD	2.111.587	1.778.272	1,62
LU1637934073	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Chf	33.025	CHF	3.180.685	3.118.927	2,84
				<b>5.292.272</b>	<b>4.897.199</b>	<b>4,46</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>13.958.589</b>	<b>13.592.495</b>	<b>12,37</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>13.958.589</b>	<b>13.592.495</b>	<b>12,37</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>111.850.579</b>	<b>105.764.936</b>	<b>96,26</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Etats-Unis d'Amérique	28,48	Banques et autres institutions financières	29,57
Suisse	9,33	Holdings et sociétés financières	14,17
Irlande	8,09	Fonds d'investissements	12,37
Canada	6,75	Supranational	7,66
Royaume-Uni	6,67	Obligations d'Etats et de villes étrangers	6,09
Pays-Bas	6,34	Alimentation, boissons	4,91
Luxembourg	6,07	Pharmacie et cosmétique	4,20
Japon	3,52	Transmission de nouvelles	3,19
France	3,25	Assurances	2,65
Allemagne	3,14	Circulation et transport	1,57
Corée du Sud	3,10	Gastronomie	1,34
Australie	2,44	Sociétés immobilières	1,26
Philippines	1,94	Energie et service des eaux	1,28
Chili	1,93	Articles de bureau et ordinateurs	1,21
Espagne	1,60	Véhicules routiers	1,04
Danemark	1,20	Electrotechnique, électronique	0,99
Suède	1,14	Chimie	0,62
Chine	0,56	Construction, matériel de construction	0,53
Nigéria	0,43	Mécanique, outillage	0,34
Mexique	0,13	Commerce de détail et grands magasins	0,34
Italie	0,05	Santé, éducation et services sociaux	0,29
Liechtenstein	0,04	Internet Software	0,15
Belgique	0,02	Services divers	0,17
Finlande	0,02	Pétrole	0,05
Bermudes	0,01	Biens de consommation divers	0,05
Portugal	0,01	Industrie horlogère	0,05
	<b>96,26</b>	Textile et habillement	0,04
		Arts graphiques et maisons d'édition	0,04
		Biotechnologie	0,01
		Papier et bois	0,02
		Industrie aéronautique et spatiale	0,01
		Caoutchouc et pneus	0,01
		Photographie et optique	0,01
		Service d'environnement et de recyclage	0,01
		Maisons de commerce diverses	0,01
		Divers	0,01
			<b>96,26</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0974264930	Ageas Nv	146	EUR	7.665	5.535	0,03
BE0003818359	Galapagos Genomics Nv	20	EUR	3.189	3.620	0,02
BE0003565737	Kbc Groupe Sa	44	EUR	2.057	1.849	0,01
BE0003826436	Telenet Group Holding	102	EUR	4.913	2.799	0,01
BE0003739530	Ucb	71	EUR	5.161	5.609	0,04
BE0974320526	Umicore Sa	26	EUR	882	828	0,00
				<b>23.867</b>	<b>20.240</b>	<b>0,11</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	35	USD	1.881	1.914	0,01
				<b>1.881</b>	<b>1.914</b>	<b>0,01</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	54	EUR	12.741	11.119	0,06
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	110	EUR	20.985	17.257	0,09
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	53	EUR	5.575	4.906	0,03
DE0005190003	Bmw-bayer.motorenwerke	150	EUR	11.013	7.067	0,04
DE000A1DAHH0	Brenntag	92	EUR	3.013	3.112	0,02
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	42	EUR	4.113	3.711	0,02
DE0005439004	Continental Ag	40	EUR	2.681	2.624	0,01
DE0006062144	Covestro Ag	141	EUR	5.924	3.930	0,02
DE0007100000	Daimler Ag / Namen-akt.	75	EUR	3.695	2.064	0,01
DE000A2E4K43	Delivery Hero Se	12	EUR	877	816	0,00
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	409	EUR	2.631	2.441	0,01
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	67	EUR	8.316	8.375	0,04
DE0005552004	Deutsche Post Ag	102	EUR	3.282	2.527	0,01
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	949	EUR	11.863	11.211	0,06
DE000ENAG999	E.on Se	700	EUR	6.204	6.609	0,04
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-.	205	EUR	5.472	3.909	0,02
DE0005785604	Fresenius Se & Co Kгаа	92	EUR	3.092	3.122	0,02
DE0006602006	Gea Group Ag	62	EUR	1.683	1.161	0,01
DE0006047004	Heidelbergcement Ag	36	EUR	1.303	1.407	0,01
DE0006048432	Henkel / Vorzug	98	EUR	9.119	7.174	0,04
DE0006070006	Hochtief Ag	60	EUR	8.492	3.630	0,02
DE000KGX8881	Kion Group	93	EUR	5.812	3.668	0,02
DE0005470405	Lanxess Ag	86	EUR	3.063	3.132	0,02
DE0006599905	Merck Kгаа	60	EUR	7.138	5.617	0,03
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	48	EUR	9.009	8.837	0,05
DE0006969603	Puma Se	73	EUR	4.249	3.971	0,02
DE0007164600	Sap Se	238	EUR	23.470	24.467	0,13
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	203	EUR	22.058	15.726	0,08
DE000SYM9999	Symrise Ag	30	EUR	2.951	2.550	0,01
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	1.434	EUR	5.086	3.239	0,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
DE000A1ML7J1	Vonovia Se /namen	43	EUR	1.903	1.929	0,01
				<b>216.813</b>	<b>181.308</b>	<b>0,97</b>
	<b>Finlande</b>					
FI0009007132	Fortum Corporation	318	EUR	7.022	4.253	0,02
FI0009013403	Kone Oyj -b-	29	EUR	1.387	1.497	0,01
FI0009007835	Metso Corp	170	EUR	4.843	3.692	0,02
FI0009013296	Neste Oil Oyj	78	EUR	2.218	2.406	0,01
FI0009000681	Nokia Oy	1.543	EUR	4.389	4.428	0,03
FI0009014377	Orion Corp (new)- Shs-b-	62	EUR	2.492	2.311	0,01
FI0009003305	Sampo Plc A	44	EUR	1.236	1.171	0,01
				<b>23.587</b>	<b>19.758</b>	<b>0,11</b>
	<b>France</b>					
FR0000120073	Air Liquide	127	EUR	13.864	14.815	0,07
FR0010313833	Arkema	16	EUR	966	1.008	0,01
FR0000051732	Atos Act.	35	EUR	2.200	2.161	0,01
FR0000120628	Axa	616	EUR	13.944	9.725	0,05
FR0000131104	Bnp Paribas	347	EUR	14.402	9.546	0,05
FR0000039299	Bollore Sa	1.275	EUR	4.905	3.200	0,02
FR0000120503	Bouygues	134	EUR	5.227	3.580	0,02
FR0000125338	Capgemini Se	64	EUR	4.657	4.928	0,03
FR0000120222	Cnp Assurances	561	EUR	10.130	5.004	0,03
FR0000120644	Danone.	181	EUR	10.713	10.614	0,06
FR0010908533	Edenred	33	EUR	1.252	1.257	0,01
FR0010242511	Edf	219	EUR	1.648	1.574	0,01
FR0000130452	Eiffage Sa	29	EUR	2.677	1.871	0,01
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	88	EUR	12.309	8.649	0,05
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	328	EUR	5.819	3.125	0,02
FR0010533075	Getlink Se	293	EUR	3.213	3.220	0,02
FR0000052292	Hermes International	11	EUR	6.959	6.917	0,04
FR0010259150	Ipsen	23	EUR	1.095	1.085	0,01
FR0000121485	Kering Sa	19	EUR	10.121	9.042	0,05
FR0000120321	L Oreal	66	EUR	15.541	15.767	0,07
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	97	EUR	6.720	5.673	0,03
FR0000121261	Michelin B /nom.	75	EUR	6.046	6.080	0,03
FR0000133308	Orange	180	EUR	2.064	2.004	0,01
FR0000121501	Peugeot Sa	378	EUR	7.539	4.598	0,02
FR0000125007	Saint-gobain	258	EUR	10.795	5.719	0,03
FR0000120578	Sanofi	278	EUR	20.947	22.278	0,11
FR0000121972	Schneider Electric Se	158	EUR	14.789	12.416	0,06
FR0000121220	Sodexo	68	EUR	6.760	4.192	0,02
FR0000130809	Ste Gen.paris -a-	230	EUR	3.992	3.530	0,02
FR0010613471	Suez Environnement Cie	428	EUR	5.066	3.970	0,02
FR0000051807	Teleperform.se	30	EUR	6.801	5.694	0,03
FR0000120271	Total Sa	567	EUR	27.138	20.065	0,10
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	31	EUR	1.940	2.083	0,01
FR0000124141	Veolia Environnement	276	EUR	6.100	5.375	0,03
FR0000125486	Vinci.	68	EUR	5.559	5.127	0,03

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000127771	Vivendi	50	EUR	939	976	0,01
				<b>274.837</b>	<b>226.868</b>	<b>1,20</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	25	USD	4.051	3.720	0,02
IE00BY9D5467	Allergan Plc	6	USD	936	968	0,01
IE00BD1RP616	Bank Of Ireland Group Plc	541	EUR	1.071	933	0,00
IE0001827041	Crh Plc	354	EUR	10.013	8.796	0,05
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	51	USD	3.597	3.611	0,02
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	57	USD	2.192	1.401	0,01
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	48	USD	4.171	3.945	0,02
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	179	EUR	6.087	4.604	0,02
				<b>32.118</b>	<b>27.978</b>	<b>0,15</b>
<b>Italie</b>						
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	486	EUR	8.349	6.031	0,03
IT0003128367	Enel	1.456	EUR	6.993	9.230	0,04
IT0003132476	Eni Spa Roma	918	EUR	13.069	8.464	0,04
NL0011585146	Ferrari N.v.	39	EUR	6.039	5.520	0,03
IT0000072618	Intesa Sanpaolo Spa	1.281	EUR	2.654	1.907	0,01
IT0000062957	Mediobanca Bca Credito Finanz.	190	EUR	1.018	955	0,01
IT0004965148	Moncler S.p.a.	48	EUR	1.558	1.598	0,01
IT0003796171	Poste Italiane Spa	456	EUR	4.636	3.520	0,02
IT0003153415	Snam Az	271	EUR	1.072	1.139	0,01
IT0003497176	Telecom Italia Spa/risp.n-cv	8.571	EUR	4.357	3.090	0,02
IT0005239360	Unicredit Spa	269	EUR	2.271	1.923	0,01
				<b>52.016</b>	<b>43.377</b>	<b>0,23</b>
<b>Japon</b>						
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	100	JPY	2.361	2.249	0,01
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	100	JPY	1.549	1.697	0,01
JP3126400005	Alps Alpine Registered Shs	100	JPY	925	886	0,00
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	300	JPY	3.696	4.232	0,02
JP3242800005	Canon Inc.	100	JPY	2.054	1.992	0,01
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	200	JPY	4.721	3.885	0,02
JP3476480003	Dai-ichi Life Hldgs Shs	100	JPY	1.128	1.094	0,01
JP3551500006	Denso Corp	100	JPY	3.010	2.947	0,02
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	200	JPY	3.313	3.272	0,02
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	200	JPY	5.738	4.135	0,02
JP3805010000	Fukuoka Financial Group	100	JPY	1.311	1.208	0,01
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	100	JPY	964	920	0,00
JP3788600009	Hitachi Ltd	200	JPY	7.408	5.307	0,03
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	200	JPY	4.298	4.103	0,02
JP3292200007	Jtekt Corp	200	JPY	1.360	1.241	0,01
JP3210200006	Kajima Corp.	100	JPY	946	936	0,00
JP3205800000	Kao Corp.	100	JPY	7.476	7.454	0,04
JP3496400007	Kddi Corp.	200	JPY	5.372	5.386	0,03
JP3982100004	Lawson Inc	100	JPY	4.964	5.006	0,03
JP3626800001	Lixil Group Shs	300	JPY	4.552	3.406	0,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	200	JPY	1.126	1.085	0,01
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	300	JPY	4.213	4.040	0,02
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	700	JPY	3.878	3.144	0,02
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	200	JPY	3.206	3.158	0,02
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	100	JPY	3.086	2.554	0,01
JP3758190007	Nexon Co Ltd	100	JPY	1.394	1.490	0,01
JP3695200000	Ngk Insulators Ltd	100	JPY	1.264	1.196	0,01
JP3743000006	Nippon Meat Packers	100	JPY	3.324	3.178	0,02
JP3735400008	Nippon Tel&tel	200	JPY	4.585	4.349	0,02
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	200	JPY	2.910	3.043	0,02
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	200	JPY	4.015	2.963	0,02
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	200	JPY	4.670	5.702	0,03
JP3201200007	Olympus Corp	200	JPY	2.065	2.637	0,01
JP3200450009	Orix Corp	200	JPY	2.748	2.196	0,01
JP3866800000	Panasonic Corp	200	JPY	1.397	1.393	0,01
JP3547670004	Persol Holdings Co. Ltd.	100	JPY	908	917	0,00
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	300	JPY	4.728	3.629	0,02
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	100	JPY	9.856	9.058	0,04
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	100	JPY	4.173	4.489	0,02
JP3435000009	Sony Corp	100	JPY	6.213	5.421	0,03
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	700	JPY	1.908	1.897	0,01
JP3407400005	Sumitomo Electric Industries	100	JPY	970	961	0,01
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	100	JPY	3.159	2.637	0,01
JP3336560002	Suntory B & F	100	JPY	3.389	3.449	0,02
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	100	JPY	5.063	4.179	0,02
JP3592200004	Toshiba Corp	100	JPY	2.070	2.009	0,01
JP3633400001	Toyota Motor Corp	100	JPY	5.305	5.488	0,03
JP3933800009	Z Holdings Corporation	600	JPY	2.168	1.763	0,01
				<b>160.937</b>	<b>149.381</b>	<b>0,80</b>
	<b>Luxembourg</b>					
LU0156801721	Tenaris Sa	170	EUR	915	949	0,01
				<b>915</b>	<b>949</b>	<b>0,01</b>
	<b>Pays-Bas</b>					
NL0012969182	Adyen B.v.	4	EUR	3.480	3.082	0,02
NL0013267909	Akzo Nobel	74	EUR	4.157	4.441	0,02
NL0010273215	Asml Holding Nv	104	EUR	20.201	25.214	0,12
NL0012059018	Exor N.v.	100	EUR	6.081	4.700	0,03
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.v	261	EUR	1.784	1.715	0,01
NL0011821202	Ing Group Nv	239	EUR	2.269	1.143	0,01
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.v.	25	EUR	1.757	1.718	0,01
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	293	EUR	5.526	6.237	0,03
NL0000009827	Koninklijke Dsm Nv	9	EUR	892	932	0,00
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	281	EUR	9.058	10.373	0,06
NL0009538784	Nxp Semiconductor	67	USD	5.801	5.064	0,03
NL0013654783	Prosus Bearer Rg Shs -n-	75	EUR	4.781	4.736	0,03
NL0000379121	Randstad Holding (eur 0.1)	121	EUR	3.814	3.893	0,02
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	315	EUR	5.608	6.261	0,03
NL0000388619	Unilever Nv.	378	EUR	18.690	16.935	0,09

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
NL0000395903	Wolters Kluwer Nv	107	EUR	6.598	6.867	0,04
				<b>100.497</b>	<b>103.311</b>	<b>0,55</b>
	<b>Autriche</b>					
AT0000730007	Andritz Ag Graz	36	EUR	984	1.029	0,01
AT0000652011	Erste Group Bank Ag	97	EUR	1.869	1.638	0,00
				<b>2.853</b>	<b>2.667</b>	<b>0,01</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	1.370	EUR	4.186	5.011	0,03
				<b>4.186</b>	<b>5.011</b>	<b>0,03</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	20	CHF	32.269	36.547	0,19
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	3.712	CHF	47.941	27.972	0,15
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	27	CHF	24.465	17.014	0,09
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	24	CHF	32.561	26.472	0,14
CH0114405324	Garmin	41	USD	3.568	2.801	0,01
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	1.096	CHF	49.959	36.504	0,19
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	550	CHF	32.258	41.367	0,22
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	237	CHF	44.713	70.108	0,38
CH0126881561	Swiss Re-namen	523	CHF	44.996	36.731	0,20
CH0008742519	Swisscom /nam.	82	CHF	33.985	40.180	0,21
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	151	CHF	41.650	48.843	0,26
				<b>388.365</b>	<b>384.539</b>	<b>2,04</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0105046009	Aena Sme Sa	41	EUR	7.139	4.080	0,02
ES0109067019	Amadeus It --- Shs-a-	23	EUR	1.085	994	0,01
ES0113900J37	Banco Santander --- Reg.shs	2.328	EUR	12.087	5.164	0,03
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	2.404	EUR	7.847	7.009	0,04
ES0130960018	Enagas	206	EUR	4.656	3.728	0,02
ES0130670112	Endesa Sa	60	EUR	1.449	1.168	0,01
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	1.412	EUR	10.345	12.684	0,06
ES0148396007	Inditex	363	EUR	9.679	8.588	0,05
ES0173093024	Red Electrica Corporacion. Sa	260	EUR	3.849	4.255	0,02
ES0173516115	Repsol Sa	743	EUR	10.118	6.191	0,03
ES0178430E18	Telefonica Sa	891	EUR	6.156	3.719	0,02
				<b>74.410</b>	<b>57.580</b>	<b>0,31</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US00287Y1091	Abbvie Inc	44	USD	3.505	3.055	0,02
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	14	USD	873	1.167	0,01
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	2	USD	2.034	2.118	0,01
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	2	USD	2.036	2.120	0,01
US0231351067	Amazon Com Inc	3	USD	5.224	5.331	0,03
US0311621009	Amgen Inc	11	USD	2.185	2.032	0,01
US0378331005	Apple Inc	40	USD	8.426	9.270	0,04
US0382221051	Applied Materials Inc	32	USD	1.816	1.336	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US03965L1008	Arconic Inc	103	USD	2.830	1.508	0,01
US00206R1023	At & T	171	USD	5.722	4.543	0,02
US09062X1037	Biogen Inc	3	USD	789	865	0,00
US1011371077	Boston Scientific Corp.	33	USD	912	981	0,01
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	73	USD	4.404	3.708	0,02
US1567821046	Cerner Corp	52	USD	3.365	2.985	0,02
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	48	USD	1.766	1.720	0,01
US1912161007	Coca-cola Co.	113	USD	4.341	4.557	0,02
US2310211063	Cummins Inc	13	USD	1.534	1.603	0,01
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	135	USD	2.884	1.778	0,01
US30303M1027	Facebook Inc -a-	16	USD	2.308	2.432	0,01
US3156161024	F5 Networks Inc.	22	USD	2.704	2.138	0,01
US4592001014	Ibm Corp	14	USD	1.368	1.415	0,01
US4781601046	Johnson & Johnson	49	USD	5.535	5.856	0,02
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	43	USD	5.403	3.957	0,02
US4943681035	Kimberly Clark Corp	29	USD	3.691	3.380	0,02
US5128071082	Lam Research Corp	9	USD	2.326	1.969	0,01
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	19	USD	2.033	1.490	0,01
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	10	USD	2.210	2.202	0,01
US58933Y1055	Merck	18	USD	1.134	1.262	0,01
US59156R1086	Metlife Inc	108	USD	4.632	3.009	0,02
US5949181045	Microsoft Corp.	76	USD	8.507	10.923	0,05
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	33	USD	1.405	1.506	0,01
US61174X1090	Monster Beverage Corp	44	USD	2.868	2.256	0,01
US6541061031	Nike Inc B	30	USD	2.188	2.262	0,01
US67066G1040	Nvidia Corp.	6	USD	1.361	1.441	0,01
US7010941042	Parker-hannifin	17	USD	1.986	2.010	0,01
US7170811035	Pfizer Inc.	32	USD	879	952	0,01
US6935061076	Ppg Industries Inc.	12	USD	950	914	0,00
US69351T1060	Ppl Corp	65	USD	1.334	1.462	0,01
US7458671010	Pultegroup Inc	223	USD	7.548	4.536	0,02
US7475251036	Qualcomm Inc.	26	USD	2.142	1.603	0,01
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	2	USD	794	890	0,00
US7591EP1005	Regions Financial Corp	261	USD	3.429	2.134	0,01
US7607591002	Republic Services Inc.	29	USD	1.921	1.984	0,01
US78409V1044	S&p Global Shs	8	USD	1.891	1.787	0,01
US8718291078	Sysco Corp.	32	USD	2.187	1.331	0,01
US87612E1064	Target Corp	20	USD	1.147	1.695	0,01
US8725401090	Tjx Companies Inc	63	USD	2.823	2.745	0,01
US89400J1079	Transunion	20	USD	1.214	1.206	0,01
US9130171096	United Technologies Corp	41	USD	3.641	3.525	0,02
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	6	USD	1.299	1.364	0,01
US92826C8394	Visa Inc -a	24	USD	3.585	3.524	0,02
US9633201069	Whirlpool Corp.	14	USD	1.935	1.095	0,01
US9884981013	Yum Brands Shs	20	USD	1.346	1.249	0,01
				<b>146.370</b>	<b>134.181</b>	<b>0,71</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>1.503.652</b>	<b>1.359.062</b>	<b>7,24</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	100.000	EUR	99.880	94.992	0,51
				<b>99.880</b>	<b>94.992</b>	<b>0,51</b>
<b>Caïmans (Iles)</b>						
US88032XAN49	Tencent Hol 3.975% 19-11.04.29	200.000	USD	193.495	203.376	1,08
				<b>193.495</b>	<b>203.376</b>	<b>1,08</b>
<b>Allemagne</b>						
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	100.000	EUR	99.636	95.062	0,51
				<b>99.636</b>	<b>95.062</b>	<b>0,51</b>
<b>France</b>						
FR0013463676	Essilor 0.75% 19-27.11.31	100.000	EUR	98.537	92.563	0,49
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	200.000	EUR	264.050	267.334	1,42
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	200.000	EUR	197.734	218.304	1,16
FR0010033381	Veolia 6.125% 03-25.11.33	200.000	EUR	322.406	312.278	1,66
FR0013424868	Vivendi 0.625% 19-11.06.25	100.000	EUR	99.912	97.523	0,52
				<b>982.639</b>	<b>988.002</b>	<b>5,25</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS1873982745	Barclays 1.5% 18-03.09.23	200.000	EUR	199.222	192.428	1,02
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	200.000	EUR	199.130	175.726	0,94
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	200.000	EUR	241.902	231.924	1,24
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	150.000	EUR	149.865	143.592	0,76
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	100.000	EUR	100.000	96.446	0,51
XS1788515606	Natwest Mark 1.75% 18-02.03.26	200.000	EUR	205.200	188.940	1,01
XS0210467873	Netwrk Rail Infra.4.75% 05-24	200.000	GBP	269.196	261.964	1,39
XS1382368113	Rbs Grp 2.5% 16-22.03.23	200.000	EUR	209.350	198.620	1,06
XS1875284702	Sse 1.375% 18-04.09.27	600.000	EUR	588.427	611.304	3,25
				<b>2.162.292</b>	<b>2.100.944</b>	<b>11,18</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	100.000	EUR	99.256	92.357	0,49
XS1883355197	Abbott Il F 1.5% 18-27.9.26 Regs	200.000	EUR	202.164	201.700	1,07
XS0802738434	Cloverie 6.625% 12-01.09.42	200.000	EUR	246.354	223.292	1,19
XS1288894691	Swisscom Ag 1.75% 15-15.09.25	200.000	EUR	212.000	210.108	1,12
XS2013626010	Zurich Fina 1.625% 19-17.06.39	200.000	EUR	218.648	182.050	0,97
				<b>978.422</b>	<b>909.507</b>	<b>4,84</b>
<b>Italie</b>						
US465410BY32	Italy 2.875% 19-17.10.29	300.000	USD	257.785	262.179	1,40
IT0004644735	Italy 4.5% 10-01.03.26 Btp	200.000	EUR	243.048	239.174	1,27
				<b>500.833</b>	<b>501.353</b>	<b>2,67</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Japon</b>						
XS1758752635	Mit Ufj 0.68% 18-26.01.23 Regs	200.000	EUR	200.266	194.004	1,04
XS2004880832	Mizu Fin 0.523% 19-10.06.24	100.000	EUR	100.000	94.506	0,50
				<b>300.266</b>	<b>288.510</b>	<b>1,54</b>
<b>Canada</b>						
CA13509PGU18	Can Housing 2.55% 18-15.12.23	100.000	CAD	66.538	67.761	0,36
XS2025468542	Cibc 0.04% 19-09.07.27	100.000	EUR	99.992	98.212	0,52
XS1945965611	Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	250.000	EUR	249.285	265.195	1,41
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	100.000	EUR	99.476	94.955	0,51
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	100.000	USD	89.116	93.089	0,50
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	100.000	EUR	99.694	94.065	0,50
				<b>704.101</b>	<b>713.277</b>	<b>3,80</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS1622624242	Actavis Fd 1.25% 17-01.06.24	200.000	EUR	197.980	200.496	1,07
XS0427291751	Bei 4.5% 09-15.10.25	100.000	EUR	130.150	126.425	0,67
EU000A1G0BL1	Efsf 2.75% 13-03.12.29	400.000	EUR	479.368	501.880	2,67
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	100.000	EUR	99.127	91.816	0,49
				<b>906.625</b>	<b>920.617</b>	<b>4,90</b>
<b>Pays-Bas</b>						
XS0177089298	Enel Inv 5.25% 03-29.09.23	200.000	EUR	249.900	230.358	1,23
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	200.000	EUR	200.000	202.000	1,08
XS1771838494	Ing Groep 1.125% 18-14.02.25	200.000	EUR	198.460	192.230	1,02
XS2056374353	Mondelez In 0.875% 19-1.10.31	200.000	EUR	197.098	186.798	0,99
				<b>845.458</b>	<b>811.386</b>	<b>4,32</b>
<b>Autriche</b>						
XS0782697071	Oebb Inf 3.375% 12-18.5.32	60.000	EUR	75.761	83.003	0,44
				<b>75.761</b>	<b>83.003</b>	<b>0,44</b>
<b>Pologne</b>						
XS0479333311	Poland 5.25% 10-20.1.25	400.000	EUR	517.600	494.860	2,64
				<b>517.600</b>	<b>494.860</b>	<b>2,64</b>
<b>Portugal</b>						
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	100.000	EUR	100.000	103.480	0,55
				<b>100.000</b>	<b>103.480</b>	<b>0,55</b>
<b>Roumanie</b>						
XS2027596530	Romania 2.124% 19-16.7.31 Regs	200.000	EUR	206.360	183.772	0,98
				<b>206.360</b>	<b>183.772</b>	<b>0,98</b>
<b>Suède</b>						
XS0191154961	Vattenf Tsy 5.375% 04-29.04.24	200.000	EUR	255.438	236.356	1,26
				<b>255.438</b>	<b>236.356</b>	<b>1,26</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Suisse</b>						
CH0409606354	Ubs Group F 1.25% 18-17.04.25	200.000	EUR	201.200	193.022	1,03
				<b>201.200</b>	<b>193.022</b>	<b>1,03</b>
<b>Espagne</b>						
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	200.000	EUR	199.172	190.634	1,02
XS1767931121	Santand 2.125% 18-8.2.28 Regs	100.000	EUR	93.230	90.666	0,48
XS1751004232	Santander 1.125% 18-17.01.25	200.000	EUR	193.436	191.690	1,02
ES00000127A2	Spanish Gov 1.95% 15-30.07.30	200.000	EUR	232.636	225.180	1,20
				<b>718.474</b>	<b>698.170</b>	<b>3,72</b>
<b>Corée du Sud</b>						
XS1999730374	Kr Hous Fin 0.10% 19-18.06.24	130.000	EUR	129.955	130.542	0,70
				<b>129.955</b>	<b>130.542</b>	<b>0,70</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	200.000	USD	178.638	200.866	1,07
XS0252367775	Amer Intl Grp 5% 06-26.4.23	200.000	GBP	250.789	244.681	1,30
US031162BV19	Amgen 3.625% 14-22.05.24	200.000	USD	163.487	192.093	1,02
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	100.000	EUR	99.248	93.503	0,50
XS1901137361	Celanese Us 2.125% 18-01.03.27	200.000	EUR	195.618	196.938	1,05
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	100.000	USD	89.563	86.346	0,46
XS2043678841	Gldm Sachs 0.125% 19-19.8.24 Regs	100.000	EUR	99.489	92.435	0,49
XS1456422135	Jpmorgan Ch 0.625% 16-25.01.24	200.000	EUR	198.786	193.044	1,03
CH0338330456	Mcdonalds 0.17% 16-04.10.24	300.000	CHF	254.539	278.271	1,48
XS1197270819	Mondelez 1.625% 15-08.03.27	100.000	EUR	101.255	101.465	0,54
US61747YDU64	Mor St 4.1%13-22.5.23	200.000	USD	164.711	187.910	1,00
XS1030900242	Verizon Com 3.25% 14-17.02.26	200.000	EUR	227.814	220.174	1,17
				<b>2.023.937</b>	<b>2.087.726</b>	<b>11,11</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>12.002.372</b>	<b>11.837.957</b>	<b>63,03</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	52	EUR	5.783	2.670	0,01
FR0010040865	Gecina /act.nom.	12	EUR	2.188	1.448	0,01
FR0000121964	Klepierre	72	EUR	2.275	1.265	0,01
				<b>10.246</b>	<b>5.383</b>	<b>0,03</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	48	USD	1.110	1.041	0,01
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	270	USD	7.031	4.095	0,02
				<b>8.141</b>	<b>5.136</b>	<b>0,03</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>18.387</b>	<b>10.519</b>	<b>0,06</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>13.524.411</b>	<b>13.207.538</b>	<b>70,33</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
CA89117FFK09	Tor Dom Bk 3.005% 18-30.05.23	100.000	CAD	66.748	65.626	0,35
				<b>66.748</b>	<b>65.626</b>	<b>0,35</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>66.748</b>	<b>65.626</b>	<b>0,35</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>66.748</b>	<b>65.626</b>	<b>0,35</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00B6TLWG59	Gam Star Cat Bd Inst Cl Eur	44.950	EUR	596.010	604.037	3,22
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	32.017	USD	193.525	193.897	1,03
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	12.946	USD	578.615	559.961	2,98
				<b>1.368.150</b>	<b>1.357.895</b>	<b>7,23</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	3.504	USD	398.189	358.559	1,91
LU1637934156	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Eur	10.117	EUR	980.418	967.570	5,15
				<b>1.378.607</b>	<b>1.326.129</b>	<b>7,06</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>2.746.757</b>	<b>2.684.024</b>	<b>14,29</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>2.746.757</b>	<b>2.684.024</b>	<b>14,29</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>16.337.916</b>	<b>15.957.188</b>	<b>84,97</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Irlande	12,22	Holdings et sociétés financières	15,19
Luxembourg	11,97	Fonds d'investissements	14,29
Etats-Unis d'Amérique	11,85	Banques et autres institutions financières	13,66
Royaume-Uni	11,18	Obligations d'Etats et de villes étrangers	10,41
France	6,48	Energie et service des eaux	7,02
Pays-Bas	4,87	Supranational	3,34
Canada	4,15	Electrotechnique, électronique	2,12
Espagne	4,03	Assurances	2,07
Suisse	3,07	Alimentation, boissons	1,83
Italie	2,90	Commerce de détail et grands magasins	1,77
Pologne	2,64	Circulation et transport	1,74
Japon	2,34	Transmission de nouvelles	1,69
Allemagne	1,48	Pharmacie et cosmétique	1,70
Suède	1,26	Arts graphiques et maisons d'édition	1,68
Caïmans (Iles)	1,08	Gastronomie	1,49
Roumanie	0,98	Chimie	1,22
Corée du Sud	0,70	Biotechnologie	1,03
Portugal	0,58	Articles de bureau et ordinateurs	0,57
Australie	0,51	Construction, matériel de construction	0,54
Autriche	0,45	Internet Software	0,34
Belgique	0,11	Pétrole	0,20
Finlande	0,11	Mécanique, outillage	0,22
Bermudes	0,01	Véhicules routiers	0,19
	<b>84,97</b>	Biens de consommation divers	0,15
		Textile et habillement	0,14
		Sociétés immobilières	0,12
		Services divers	0,07
		Caoutchouc et pneus	0,04
		Papier et bois	0,04
		Santé, éducation et services sociaux	0,03
		Industrie aéronautique et spatiale	0,02
		Photographie et optique	0,01
		Métaux non ferreux	0,01
		Service d'environnement et de recyclage	0,01
		Maisons de commerce diverses	0,01
		Mines, aciéries	0,01
			<b>84,97</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0003826436	Telenet Group Holding	1.501	EUR	63.913	43.726	0,01
BE0003739530	Ucb	1.186	EUR	112.014	99.470	0,01
				<b>175.927</b>	<b>143.196</b>	<b>0,02</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	1.720	USD	135.942	99.851	0,01
				<b>135.942</b>	<b>99.851</b>	<b>0,01</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	1.379	USD	19.699	17.999	0,00
				<b>19.699</b>	<b>17.999</b>	<b>0,00</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	548	EUR	169.412	119.789	0,02
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	1.175	EUR	256.229	195.696	0,02
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	586	EUR	66.454	54.965	0,01
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	3.653	EUR	24.907	23.149	0,00
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	962	EUR	146.995	127.663	0,02
DE0005552004	Deutsche Post Ag	3.710	EUR	140.749	97.581	0,01
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	4.521	EUR	57.454	56.704	0,01
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-.	4.220	EUR	118.991	85.436	0,01
DE0006048432	Henkel / Vorzug	797	EUR	60.551	61.937	0,01
DE0006048408	Henkel Ag & Co. Kгаа	688	EUR	45.795	49.193	0,01
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	667	EUR	145.831	130.364	0,02
DE0007164600	Sap Se	1.319	EUR	138.403	143.952	0,01
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	1.218	EUR	137.358	100.175	0,01
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	31.911	EUR	134.489	76.531	0,01
DE000UNSE018	Uniper Se	2.277	EUR	64.697	54.367	0,01
				<b>1.708.315</b>	<b>1.377.502</b>	<b>0,18</b>
<b>Finlande</b>						
FI0009007132	Fortum Corporation	1.781	EUR	24.842	25.289	0,00
FI0009007835	Metso Corp	3.680	EUR	130.397	84.858	0,02
FI0009000681	Nokia Oy	9.362	EUR	28.220	28.515	0,00
				<b>183.459</b>	<b>138.662</b>	<b>0,02</b>
<b>France</b>						
FR0000120073	Air Liquide	1.390	EUR	179.032	172.139	0,02
FR0000120628	Axa	7.871	EUR	212.582	131.928	0,02
FR0000131104	Bnp Paribas	2.784	EUR	88.789	81.309	0,01
FR0000120644	Danone.	1.118	EUR	66.700	69.601	0,01
FR0000130452	Eiffage Sa	1.242	EUR	135.854	85.047	0,01
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	1.050	EUR	158.073	109.555	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	5.470	EUR	106.834	55.319	0,01
FR0000121485	Kering Sa	249	EUR	156.626	125.804	0,02
FR0000120321	L Oreal	351	EUR	102.048	89.023	0,01
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	636	EUR	38.985	39.486	0,01
FR0000121261	Michelin B /nom.	697	EUR	59.544	59.982	0,01
FR0000125007	Saint-gobain	4.469	EUR	184.745	105.162	0,01
FR0000120578	Sanofi	1.810	EUR	153.990	153.995	0,02
FR0000121972	Schneider Electric Se	1.849	EUR	202.568	154.251	0,02
FR0010613471	Suez Environnement Cie	7.238	EUR	104.918	71.279	0,01
FR0000120271	Total Sa	6.144	EUR	329.920	230.840	0,02
FR0000124141	Veolia Environnement	4.431	EUR	115.801	91.613	0,01
				<b>2.397.009</b>	<b>1.826.333</b>	<b>0,23</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00B02J6398	Admiral Group Plc	1.611	GBP	42.203	43.100	0,01
GB0000536739	Ashtead Group Plc	2.511	GBP	76.080	53.185	0,01
GB0006731235	Associated British Foods Plc	4.089	GBP	132.387	88.988	0,01
GB0009895292	Astrazeneca Plc	1.761	GBP	140.880	152.452	0,02
GB0031348658	Barclays Plc	47.321	GBP	57.885	53.428	0,01
GB0007980591	Bp Plc	57.469	GBP	263.762	237.314	0,03
GB0031743007	Burberry Group Plc	6.040	GBP	163.913	95.977	0,01
GB00B033F229	Centrica Plc	93.760	GBP	177.437	42.834	0,01
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	3.268	GBP	42.289	49.557	0,01
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	12.126	GBP	254.460	220.340	0,03
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	20.210	GBP	158.748	110.138	0,01
GB0008706128	Lloyds Banking Group Plc	51.462	GBP	21.858	19.757	0,00
GB0031274896	Marks And Spencer /new	27.586	GBP	64.909	32.844	0,00
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	57.041	GBP	133.992	62.616	0,01
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	6.673	GBP	67.654	32.023	0,00
GB0032089863	Next Plc	590	GBP	45.039	28.823	0,00
GB0006825383	Persimmon Plc	2.246	GBP	81.054	51.641	0,01
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	958	GBP	63.701	70.684	0,01
GB00B2B0DG97	Relx Plc	7.277	GBP	183.368	151.209	0,02
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	3.938	GBP	173.960	175.680	0,02
GB00B8C3BL03	Sage Grp	2.977	GBP	20.229	21.136	0,00
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	2.270	GBP	37.144	39.066	0,00
GB0004082847	Standard Chartered Plc	11.153	GBP	61.056	59.650	0,01
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	56.543	GBP	103.996	79.707	0,01
GB0008847096	Tesco Plc	18.087	GBP	46.329	49.648	0,01
GB00B10RZP78	Unilever Plc	3.297	GBP	196.282	161.205	0,02
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	98.095	GBP	181.758	132.985	0,02
				<b>2.992.373</b>	<b>2.315.987</b>	<b>0,30</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	793	USD	119.964	125.263	0,03
IE00BY9D5467	Allergan Plc	192	USD	31.749	32.900	0,00
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	1.330	USD	105.343	99.975	0,01
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	2.614	USD	103.180	68.187	0,01
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	1.291	USD	118.939	112.645	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	3.352	EUR	121.185	91.528	0,01
				<b>600.360</b>	<b>530.498</b>	<b>0,07</b>
	<b>Italie</b>					
IT0003128367	Enel	20.325	EUR	116.306	136.783	0,01
IT0003132476	Eni Spa Roma	11.889	EUR	192.058	116.374	0,01
NL0011585146	Ferrari N.v.	327	EUR	48.488	49.140	0,01
IT0003796171	Poste Italiane Spa	4.866	EUR	54.115	39.881	0,01
				<b>410.967</b>	<b>342.178</b>	<b>0,04</b>
	<b>Japon</b>					
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	1.600	JPY	40.039	38.202	0,00
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	1.900	JPY	31.189	34.236	0,00
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	8.800	JPY	132.340	131.792	0,02
JP3242800005	Canon Inc.	3.400	JPY	74.007	71.885	0,01
JP3566800003	Central Japan Railway Co	600	JPY	95.619	93.139	0,01
JP3511800009	Chiba Bank	18.200	JPY	99.759	77.155	0,01
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	4.600	JPY	110.458	94.865	0,01
JP3485800001	Daicel --- Shs	10.800	JPY	112.159	76.372	0,01
JP3551500006	Denso Corp	3.500	JPY	141.547	109.509	0,01
JP3160400002	Eisai Co.ltd	700	JPY	46.669	49.757	0,01
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	3.900	JPY	68.453	67.741	0,01
JP3802400006	Fanuc Corp --- Shs	200	JPY	26.982	26.269	0,00
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	100	JPY	44.288	39.605	0,01
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	4.000	JPY	122.228	87.797	0,01
JP3818000006	Fujitsu Ltd	900	JPY	78.467	78.687	0,01
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	2.500	JPY	25.529	24.423	0,00
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	900	JPY	53.358	64.369	0,01
JP3788600009	Hitachi Ltd	4.800	JPY	170.607	135.212	0,02
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	4.200	JPY	95.661	91.472	0,01
JP3837800006	Hoya Corp	500	JPY	39.420	41.228	0,01
JP3294460005	Inpex Corp	17.400	JPY	165.010	94.941	0,01
JP3143900003	Itochu Techno-solutions	2.300	JPY	60.614	63.594	0,01
JP3205800000	Kao Corp.	1.900	JPY	155.220	150.364	0,02
JP3496400007	Kddi Corp.	3.800	JPY	108.171	108.644	0,01
JP3266400005	Kubota Corp	1.800	JPY	20.791	22.287	0,00
JP3982100004	Lawson Inc	1.500	JPY	82.161	79.722	0,01
JP3626800001	Lixil Group Shs	8.200	JPY	141.521	98.848	0,01
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	6.100	JPY	90.785	87.201	0,01
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	16.300	JPY	97.898	77.720	0,01
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	1.600	JPY	27.184	26.823	0,00
JP3885780001	Mizuho Financial Groupinc	48.800	JPY	57.760	54.059	0,01
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	3.700	JPY	121.201	100.313	0,01
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	1.000	JPY	48.380	49.043	0,01
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	300	JPY	114.495	111.879	0,01
JP3743000006	Nippon Meat Packers	1.800	JPY	75.722	60.739	0,01
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co.ltd.	900	JPY	46.100	45.655	0,01
JP3735400008	Nippon Tel&tel	4.700	JPY	114.368	108.490	0,01
JP3672400003	Nissan Motor Co.ltd	7.900	JPY	27.822	25.249	0,00
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	2.600	JPY	40.088	41.991	0,01



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	2.200	JPY	123.902	95.137	0,01
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	5.500	JPY	124.754	86.511	0,01
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	5.000	JPY	133.161	151.332	0,02
JP3190000004	Obayashi Corp.	10.800	JPY	99.161	89.633	0,01
JP3201200007	Olympus Corp	6.400	JPY	73.946	89.597	0,01
JP3200450009	Orix Corp	5.700	JPY	82.832	66.438	0,01
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	700	JPY	24.278	26.544	0,00
JP3866800000	Panasonic Corp	3.800	JPY	28.124	28.098	0,00
JP3970300004	Recruit Holdings Co.ltd.	1.800	JPY	49.105	45.107	0,01
JP3336000009	Santen Pharmaceutical	1.400	JPY	24.423	23.313	0,00
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	4.500	JPY	77.503	57.795	0,01
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	1.500	JPY	131.639	144.252	0,02
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	600	JPY	26.536	28.592	0,00
JP3435000009	Sony Corp	3.600	JPY	237.367	207.174	0,03
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	9.200	JPY	26.577	26.468	0,00
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	2.100	JPY	54.404	49.368	0,01
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	3.300	JPY	115.437	92.397	0,01
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	2.600	JPY	75.243	80.627	0,01
JP3336560002	Suntory B & F	2.400	JPY	86.189	87.869	0,01
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Tokyo	3.200	JPY	87.980	53.058	0,01
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	2.000	JPY	58.741	59.296	0,01
JP3544000007	Teijin Ltd	4.000	JPY	75.922	65.606	0,01
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	2.900	JPY	155.841	128.657	0,02
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	700	JPY	148.569	127.703	0,02
JP3629000005	Toppan Printing Co.ltd	2.800	JPY	49.817	41.557	0,01
JP3592200004	Toshiba Corp	2.000	JPY	43.867	42.662	0,01
JP3595200001	Tosoh Corp	7.900	JPY	117.799	87.089	0,01
JP3633400001	Toyota Motor Corp	2.861	JPY	175.526	166.697	0,02
JP3933800009	Z Holdings Corporation	21.900	JPY	88.399	68.305	0,01
				<b>5.801.112</b>	<b>5.158.159</b>	<b>0,66</b>
<b>Jersey</b>						
GB00B19NLV48	Experian Plc	2.498	GBP	65.966	67.460	0,01
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	1.604	GBP	138.823	97.295	0,01
				<b>204.789</b>	<b>164.755</b>	<b>0,02</b>
<b>Canada</b>						
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Limited	1.330	CAD	53.704	50.792	0,01
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	8.018	CAD	307.237	85.844	0,01
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	1.897	CAD	43.634	42.748	0,01
CA0467894006	Atco Ltd - Cl I Non Voting	2.938	CAD	109.487	77.829	0,01
CA0641491075	Bank Of Nova Scotia	1.088	CAD	42.514	42.504	0,01
CA05534B7604	Bce Inc	2.436	CAD	99.975	95.596	0,01
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	10.473	CAD	320.950	137.045	0,02
CA1363751027	Canadian National Railway	842	CAD	60.918	62.977	0,01
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Co	127	CAD	25.953	26.810	0,00
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	1.095	CAD	118.660	63.225	0,01
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	2.613	CAD	81.953	59.753	0,01
CA15135U1093	Cenovus Energy	33.995	CAD	335.205	65.629	0,01
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	2.108	CAD	117.671	109.177	0,01



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CA1254911003	Ci Financial Corp	8.038	CAD	134.949	76.332	0,01
CA2908761018	Emera Inc	1.364	CAD	47.024	51.460	0,01
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	3.952	CAD	74.575	73.958	0,01
CA29250N1050	Enbridge Inc.	2.623	CAD	72.650	73.069	0,01
CA9611485090	George Weston Ltd	371	CAD	24.036	25.378	0,00
CA4488112083	Hydro One Ltd	1.570	CAD	27.218	27.044	0,00
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	3.105	CAD	125.265	93.377	0,01
CA45823T1066	Intact Fin	590	CAD	47.981	48.781	0,01
CA4969024047	Kinross Gold Corp	6.527	CAD	29.670	25.068	0,00
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	1.891	CAD	60.120	53.282	0,01
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	1.669	CAD	69.272	82.311	0,01
CA5592224011	Magna International Inc	3.532	CAD	197.257	107.827	0,01
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	12.596	CAD	226.269	151.298	0,02
CA6330671034	National Bank Of Canada	2.915	CAD	157.998	107.775	0,01
CA67077M1086	Nutrien Ltd	1.315	CAD	39.159	43.005	0,01
CA6837151068	Open Text Corp	1.366	CAD	43.205	45.695	0,01
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	6.321	CAD	226.186	106.604	0,01
CA7392391016	Power Corp.canada	7.009	CAD	162.361	107.868	0,01
CA7481932084	Quebecor Inc	3.451	CAD	84.318	72.981	0,01
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	1.370	CAD	58.414	52.813	0,01
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	2.377	CAD	175.320	140.851	0,02
CA82509L1076	Shopify Inc	149	CAD	64.525	59.720	0,01
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	3.500	CAD	138.632	107.706	0,01
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	2.689	CAD	134.817	109.363	0,01
CA94106B1013	Waste Connections Inc	312	USD	21.818	23.395	0,00
				<b>4.160.900</b>	<b>2.786.890</b>	<b>0,36</b>
	<b>Liechtenstein</b>					
LI0355147575	Liechtenst	4.519	CHF	259.250	244.026	0,03
				<b>259.250</b>	<b>244.026</b>	<b>0,03</b>
	<b>Pays-Bas</b>					
NL0012969182	Adyen B.v.	39	EUR	30.407	31.906	0,00
NL0000687663	Aercap Holdings Nv	3.246	USD	199.514	71.576	0,01
NL0010273215	Asml Holding Nv	677	EUR	175.729	174.257	0,03
NL0012059018	Exor N.v.	1.290	EUR	63.551	64.368	0,01
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	4.103	EUR	87.570	92.716	0,01
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	9.816	EUR	29.166	22.676	0,00
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	3.508	EUR	140.454	137.481	0,02
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	1.452	EUR	29.941	30.637	0,00
NL0000388619	Unilever Nv.	3.155	EUR	185.884	150.074	0,02
				<b>942.216</b>	<b>775.691</b>	<b>0,10</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	8.942	EUR	30.846	34.726	0,01
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	2.590	EUR	42.588	28.583	0,00
				<b>73.434</b>	<b>63.309</b>	<b>0,01</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Suisse</b>						
CH0012221716	Abb	199.414	CHF	2.975.576	3.391.035	0,43
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	35.794	CHF	2.521.328	1.365.183	0,17
CH0432492467	Alcon Inc.	30.737	CHF	1.375.585	1.516.256	0,19
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	54.700	CHF	884.949	298.115	0,04
CH0012410517	Baloise Holding/namen	11.613	CHF	1.734.055	1.473.690	0,19
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	614	CHF	1.126.258	1.191.160	0,15
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	263	CHF	1.081.689	1.646.380	0,21
CH0198251305	Coca-cola Hbc	1.314	GBP	26.402	27.382	0,00
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	329.869	CHF	5.562.042	2.638.952	0,34
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	1.219	CHF	1.524.929	815.511	0,10
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	884	CHF	1.272.865	1.035.164	0,13
CH0114405324	Garmin	1.190	USD	108.620	86.308	0,01
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	5.095	CHF	1.897.998	2.170.470	0,28
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	645	CHF	1.392.591	1.931.775	0,25
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	515	CHF	463.583	593.280	0,08
CH0023868554	Implenia Ag	8.038	CHF	636.090	274.900	0,04
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	1.329	CHF	806.761	837.270	0,11
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	52.234	CHF	2.759.921	1.846.994	0,24
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	11.330	CHF	847.415	754.578	0,10
CH0108503795	Meyer Burger	326.898	CHF	555.656	50.375	0,01
CH0038863350	Nestle / Act Nom	194.539	CHF	9.837.125	19.346.903	2,47
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	194.403	CHF	12.710.827	15.523.080	1,98
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	60.098	CHF	12.739.349	18.873.776	2,41
CH0024638196	Schindler Holding/partic	8.736	CHF	1.842.587	1.855.526	0,24
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	672	CHF	772.777	631.008	0,08
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	128.324	CHF	1.326.460	1.858.132	0,24
CH0418792922	Sika Ltd	10.190	CHF	1.295.915	1.629.891	0,21
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	10.278	CHF	1.585.147	1.792.483	0,23
CH0002178181	Stadler Rail Ag	9.563	CHF	363.394	427.466	0,05
CH0126881561	Swiss Re-namen	49.824	CHF	4.346.025	3.714.877	0,47
CH0008742519	Swisscom /nam.	5.595	CHF	2.843.433	2.910.519	0,37
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	14.842	CHF	1.119.949	565.183	0,07
CH0244767585	Ubs Group Ag	435.250	CHF	11.991.225	3.937.272	0,50
CH0311864901	Vat Group Ltd	6.647	CHF	790.492	890.698	0,11
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	1.590	CHF	90.555	75.684	0,01
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	16.545	CHF	4.393.223	5.681.553	0,73
				<b>97.602.796</b>	<b>103.658.829</b>	<b>13,24</b>
<b>Espagne</b>						
ES0105046009	Aena Sme Sa	647	EUR	124.766	68.359	0,01
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	26.252	EUR	90.805	81.256	0,01
ES0130670112	Endesa Sa	4.022	EUR	104.355	83.136	0,01
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	5.897	EUR	55.072	56.245	0,01
ES0148396007	Inditex	2.839	EUR	70.713	71.311	0,01
ES0173516115	Repsol Sa	13.131	EUR	179.193	116.151	0,01
				<b>624.904</b>	<b>476.458</b>	<b>0,06</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	1.811	USD	94.217	138.269	0,02
US00287Y1091	Abbvie Inc	1.543	USD	134.751	113.746	0,01
US00130H1059	Aes Corp.	4.537	USD	47.281	59.701	0,01
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	603	USD	42.896	53.378	0,01
US0171751003	Alleghany Corp (del)	80	USD	62.860	42.754	0,01
US0200021014	Allstate Corp	645	USD	70.646	57.246	0,01
US02005N1000	Ally Financial Inc	2.349	USD	61.883	32.796	0,00
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	137	USD	147.669	154.022	0,02
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	222	USD	192.279	249.766	0,04
US0231351067	Amazon Com Inc	208	USD	260.192	392.381	0,06
US0258161092	American Express Co.	970	USD	105.158	80.347	0,01
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	481	USD	77.946	47.693	0,01
US0311621009	Amgen Inc	575	USD	118.455	112.787	0,01
US0378331005	Apple Inc	2.314	USD	292.848	569.332	0,08
US0382221051	Applied Materials Inc	2.012	USD	122.638	89.198	0,01
US03965L1008	Arconic Inc	4.177	USD	116.610	64.906	0,01
US04621X1081	Assurant Inc	585	USD	81.373	58.917	0,01
US00206R1023	At & T	6.008	USD	215.483	169.450	0,02
US0605051046	Bank Of America Corp	2.350	USD	48.516	48.272	0,01
US0718131099	Baxter Intl Inc	488	USD	34.083	38.335	0,00
US0865161014	Best Buy Co Inc.	615	USD	45.029	33.917	0,00
US09062X1037	Biogen Inc	89	USD	24.817	27.244	0,00
US1011371077	Boston Scientific Corp.	1.114	USD	32.613	35.170	0,00
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	1.430	USD	91.567	77.122	0,01
US1491231015	Caterpillar Inc.	224	USD	22.941	25.150	0,00
US12504L1098	Cbre Group -a-	2.117	USD	103.404	77.242	0,01
US1567821046	Cerner Corp	1.492	USD	106.048	90.931	0,01
US1667641005	Chevron Corporation	800	USD	54.222	56.087	0,01
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	3.897	USD	102.449	148.220	0,02
US1729674242	Citigroup Inc	2.942	USD	187.290	119.896	0,02
US1746101054	Citizens Financial Group Inc	2.134	USD	74.448	38.838	0,00
US1890541097	Clorox Co *opa*	123	USD	19.937	20.618	0,00
US1912161007	Coca-cola Co.	3.878	USD	227.552	166.033	0,02
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	560	USD	32.816	35.956	0,00
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	1.204	USD	39.547	40.050	0,01
US20825C1045	Conocophillips	3.649	USD	168.450	108.742	0,01
US2310211063	Cummins Inc	279	USD	34.880	36.529	0,00
US2566771059	Dollar General Corporation	162	USD	19.608	23.670	0,00
US2600031080	Dover Corp.	1.201	USD	115.748	97.541	0,01
US26441C2044	Duke Energy	854	USD	62.427	66.830	0,01
US2855121099	Electronic Arts	655	USD	70.278	63.482	0,01
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	5.573	USD	129.462	77.917	0,01
US30303M1027	Facebook Inc -a-	1.187	USD	213.381	191.567	0,02
US3156161024	F5 Networks Inc.	695	USD	90.674	71.703	0,01
US3696041033	General Electric Co	5.211	USD	38.546	40.033	0,01
US3703341046	General Mills Inc	1.048	USD	55.738	53.508	0,01
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	463	USD	31.557	33.491	0,00
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	239	USD	36.277	35.748	0,00

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US4361061082	Hollyfrontier Corp	1.068	USD	57.246	25.327	0,00
US4370761029	Home Depot Inc.	434	USD	77.184	78.403	0,01
US4592001014	Ibm Corp	621	USD	64.316	66.652	0,01
US4581401001	Intel Corp.	2.037	USD	116.407	106.665	0,01
US4612021034	Intuit	234	USD	53.251	52.074	0,01
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	56	USD	25.222	26.832	0,00
US4781601046	Johnson & Johnson	1.937	USD	266.242	245.757	0,04
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	416	USD	58.946	40.645	0,01
US4851703029	Kansas City Southern	413	USD	60.824	50.821	0,01
US4943681035	Kimberly Clark Corp	779	USD	103.210	96.378	0,01
US5128071082	Lam Research Corp	374	USD	89.620	86.847	0,01
US5312294094	Liberty Media Corp	1.468	USD	73.361	45.011	0,01
US5324571083	Lilly (eli) & Co	353	USD	42.117	47.379	0,01
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	814	USD	93.347	67.772	0,01
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	773	USD	195.519	180.667	0,02
US58155Q1031	Mckesson Corp	259	USD	34.999	33.896	0,00
US58933Y1055	Merck	2.212	USD	136.086	164.669	0,02
US59156R1086	Metlife Inc	3.400	USD	159.188	100.565	0,01
US5949181045	Microsoft Corp.	4.034	USD	211.717	615.557	0,09
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	1.087	USD	49.041	52.671	0,01
US61174X1090	Monster Beverage Corp	1.516	USD	104.864	82.523	0,01
US6153691059	Moody S Corp	496	USD	122.466	101.500	0,01
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	187	USD	24.456	24.049	0,00
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	841	USD	39.119	36.845	0,00
US6541061031	Nike Inc B	776	USD	59.990	62.123	0,01
US65473P1057	Nisource Inc	2.063	USD	46.083	49.842	0,01
US67066G1040	Nvidia Corp.	323	USD	77.625	82.380	0,01
US6907421019	Owens Corning Inc	1.845	USD	119.838	69.281	0,01
US7010941042	Parker-hannifin	398	USD	49.274	49.957	0,01
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	356	USD	42.133	32.977	0,00
US7134481081	Pepsico Inc	337	USD	44.968	39.160	0,01
US7170811035	Pfizer Inc.	2.241	USD	65.233	70.773	0,01
US7512121010	Polo Ralph Lauren	497	USD	51.227	32.137	0,00
US6935061076	Ppg Industries Inc.	551	USD	46.208	44.569	0,01
US69351T1060	Ppl Corp	2.299	USD	50.005	54.898	0,01
US7458671010	Pultegroup Inc	4.753	USD	184.884	102.644	0,01
US74736K1016	Qorvo Inc	448	USD	41.561	34.950	0,00
US7475251036	Qualcomm Inc.	1.416	USD	122.550	92.684	0,01
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	48	USD	20.185	22.677	0,00
US7591EP1005	Regions Financial Corp	9.338	USD	146.019	81.044	0,01
US7607591002	Republic Services Inc.	1.091	USD	84.094	79.233	0,01
US79466L3024	Salesforce Com Inc	344	USD	49.498	47.922	0,01
US8330341012	Snap-on Inc	436	USD	69.103	45.906	0,01
US78409V1044	S&p Global Shs	465	USD	120.248	110.251	0,01
US87165B1035	Synchrony Financial	3.609	USD	117.059	56.184	0,01
US8716071076	Synopsys Inc.	222	USD	26.353	27.664	0,00
US8718291078	Sysco Corp.	1.551	USD	100.437	68.476	0,01
US87612E1064	Target Corp	715	USD	50.922	64.317	0,01
US8725401090	Tjx Companies Inc	2.352	USD	137.594	108.800	0,01
US89400J1079	Transunion	363	USD	23.360	23.244	0,00

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US9024941034	Tyson Foods Inc.-a-	566	USD	42.724	31.692	0,00
US9078181081	Union Pacific Corp.	483	USD	62.812	65.912	0,01
US9113631090	United Rentals Inc.	562	USD	71.354	55.953	0,01
US9130171096	United Technologies Corp	1.223	USD	115.105	111.622	0,01
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	736	USD	122.148	177.588	0,02
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	137	USD	28.162	31.541	0,00
US92826C8394	Visa Inc -a	1.319	USD	217.872	205.621	0,04
US2546871060	Walt Disney	416	USD	41.001	38.882	0,00
US9633201069	Whirlpool Corp.	430	USD	61.141	35.697	0,00
US9884981013	Yum Brands Shs	535	USD	38.145	35.474	0,00
US88579Y1010	3m Co	192	USD	24.711	25.359	0,00
				<b>9.589.864</b>	<b>9.265.470</b>	<b>1,18</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>127.883.316</b>	<b>129.385.793</b>	<b>16,53</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
CH0512502995	Cw Bk Austr 0.113% 19-10.12.29	2.000.000	CHF	2.000.000	1.814.500	0,23
CH0346828434	Nat Aus Bk 0.3% 17-31.10.25	2.000.000	CHF	1.952.098	1.900.000	0,24
XS0414590009	Nsw Tsy 5%09-25.02.39	4.000.000	GBP	6.979.608	8.076.571	1,03
CH0340912168	Transurban 0.65% 16-02.11.26	2.000.000	CHF	1.910.096	1.844.500	0,24
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	700.000	EUR	795.878	705.934	0,09
CH0458097950	Westpac Bk 0.25% 19-29.01.27	1.000.000	CHF	1.001.190	1.016.750	0,13
CH0417086060	Westpac Bk 0.4% 18-06.06.24	2.000.000	CHF	2.004.900	1.963.000	0,25
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	750.000	USD	729.391	723.979	0,09
CH0330049831	Wplau 1% 16-11.12.23	3.850.000	CHF	3.989.855	3.884.650	0,50
				<b>21.363.016</b>	<b>21.929.884</b>	<b>2,80</b>
<b>Bermudes</b>						
CH0401956898	Cbq Finance 0.697% 18-22.03.21	3.500.000	CHF	3.498.250	3.417.050	0,44
				<b>3.498.250</b>	<b>3.417.050</b>	<b>0,44</b>
<b>Chili</b>						
CH0496632628	Bc Sant Cl 0.135% 19-29.08.29	2.500.000	CHF	2.497.500	1.975.000	0,26
CH0465767785	Bc Sant Cl 0.384% 19-27.09.24	2.000.000	CHF	2.000.000	1.838.500	0,23
CH0479222066	Bco Dest Cl 0.24% 19-06.06.25	1.500.000	CHF	1.500.000	1.326.000	0,17
CH0506071239	Credito 0.10% 20-18.09.26	1.000.000	CHF	1.000.080	883.000	0,11
CH0505011889	Credito 0.25% 19-29.10.25	1.000.000	CHF	1.000.150	905.000	0,12
				<b>7.997.730</b>	<b>6.927.500</b>	<b>0,89</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	3.000.000	USD	3.032.525	3.097.070	0,40
				<b>3.032.525</b>	<b>3.097.070</b>	<b>0,40</b>
<b>Danemark</b>						
CH0026985520	Kommkrdt 2.875% 06-13.10.31	6.000.000	CHF	6.080.400	7.917.000	1,01
				<b>6.080.400</b>	<b>7.917.000</b>	<b>1,01</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Allemagne</b>						
CH0358181219	Deut Bk 0.75% 17-21.03.22	2.500.000	CHF	2.536.100	2.438.125	0,31
CH0399198396	Deutsche Bk 0.625% 18-08.02.23	6.150.000	CHF	6.134.076	5.793.301	0,75
CH0479514272	Dt Bahn Fin 0.10% 19-19.06.29	1.040.000	CHF	1.040.520	1.001.260	0,13
XS2101357072	Fresenius 0.75% 20-15.01.28	1.500.000	EUR	1.616.287	1.499.467	0,19
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	900.000	USD	889.615	928.451	0,12
CH0022268004	Kfw 2.5% 05-25.08.25	5.000.000	CHF	4.962.500	5.751.250	0,73
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	500.000	EUR	538.143	504.610	0,06
CH0471297991	Munhyp 0.25% 19-10.05.30	2.000.000	CHF	2.002.160	2.058.000	0,26
				<b>19.719.401</b>	<b>19.974.464</b>	<b>2,55</b>
<b>Côte d'Ivoire</b>						
XS0043037505	Afdb 7.375% 93-06.04.23	10.000.000	USD	15.616.577	11.567.451	1,48
				<b>15.616.577</b>	<b>11.567.451</b>	<b>1,48</b>
<b>France</b>						
CH0368825474	Bfcm 0.4% 17-19.12.25 Regs	5.000.000	CHF	4.937.600	4.975.000	0,64
CH0379610972	Bfcm 0.6% 17-05.04.27	3.000.000	CHF	3.004.900	2.977.500	0,38
FR0013459757	C Fr Fi Loc 0.10% 19-13.11.29	500.000	EUR	548.476	524.548	0,07
FR0013398229	Gdf Suez 3.25% 19-perp	100.000	EUR	111.654	105.444	0,01
XS0123656836	Reseau Ferre 5.25% 01-31.1.35	1.000.000	GBP	2.198.831	1.800.483	0,23
XS0096412548	Rff 5.25% 99-07.12.28	3.500.000	GBP	8.652.211	5.637.282	0,72
XS0144628053	Sncf 5.375% 02-18.03.27	1.700.000	GBP	4.245.943	2.632.808	0,34
CH0404311687	Socgen 0.7% 18-26.02.25	5.000.000	CHF	5.010.100	4.700.000	0,60
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	1.500.000	EUR	1.764.692	1.738.210	0,22
FR0010033381	Veolia 6.125% 03-25.11.33	2.000.000	EUR	3.306.076	3.315.284	0,42
				<b>33.780.483</b>	<b>28.406.559</b>	<b>3,63</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
CH0426621683	Barclays 1.125% 18-12.07.23	3.000.000	CHF	3.013.600	2.962.500	0,38
CH0461239094	Bnz Intl Ln 0.111% 20-24.07.28	4.000.000	CHF	3.999.999	3.737.000	0,48
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	850.000	EUR	926.727	792.874	0,10
XS0091740018	Ebrd 5.625% 98-07.12.28	2.000.000	GBP	3.689.980	3.386.361	0,43
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	5.000.000	EUR	7.663.119	6.155.523	0,80
CH0429659607	Lloyds Bk 1% 18-04.03.25	2.000.000	CHF	1.999.300	1.916.000	0,24
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	600.000	EUR	665.165	609.775	0,08
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	400.000	EUR	432.378	409.566	0,05
CH0488506699	Natwest Mar 0.125% 19-13.09.23	2.000.000	CHF	2.001.800	1.903.000	0,24
XS1788515606	Natwest Mark 1.75% 18-02.03.26	1.000.000	EUR	1.170.016	1.002.936	0,13
XS0225051811	Net Rail Infr.4.625%05-21.7.20	2.000.000	GBP	4.622.808	2.430.357	0,31
CH0373314894	Wstp 0.125% 17-15.12.22	2.500.000	CHF	2.513.600	2.450.000	0,31
				<b>32.698.492</b>	<b>27.755.892</b>	<b>3,55</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	950.000	EUR	1.025.282	931.478	0,12
XS0361336356	Ge Capital Uk 6.25% 08-5.5.38	2.750.000	GBP	3.960.182	3.968.030	0,51
				<b>4.985.464</b>	<b>4.899.508</b>	<b>0,63</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Italie</b>						
XS0306646042	Enel Societa 5.625% 07-21.6.27	2.000.000	EUR	3.166.771	2.739.978	0,35
IT0004513641	Italy 5% 09-1.3.25 Btp	1.000.000	EUR	1.256.884	1.268.039	0,16
US465410AH18	Italy 6.875% 93-27.09.23	9.500.000	USD	12.515.082	10.579.496	1,35
				<b>16.938.737</b>	<b>14.587.513</b>	<b>1,86</b>
<b>Japon</b>						
XS0159205995	Dbj 1.7% 02-20.09.22	700.000.000	JPY	6.995.032	6.537.712	0,84
				<b>6.995.032</b>	<b>6.537.712</b>	<b>0,84</b>
<b>Jersey</b>						
CH0310451841	Ubs Grp Fdg 0.75% 16-22.02.22	5.000.000	CHF	5.118.850	4.973.750	0,64
				<b>5.118.850</b>	<b>4.973.750</b>	<b>0,64</b>
<b>Canada</b>						
CH0413618346	Cibc 0.1% 18-30.04.25	2.000.000	CHF	1.985.640	2.019.500	0,26
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	300.000	USD	293.407	253.303	0,03
US563469UD51	Manitoba 3.05% 14-14.05.24	8.000.000	USD	7.211.862	8.428.137	1,08
US6832348K70	Ontario 4.4% 10-14.04.20	5.000.000	USD	5.108.444	4.843.557	0,62
US748149AQ48	Quebec Prov 2.5% 19-09.04.24 Sr Qw	1.050.000	USD	1.045.940	1.082.298	0,14
US748148QR73	Quebec 7.5% 99-15.09.29	2.000.000	USD	2.854.272	2.986.054	0,38
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	850.000	EUR	964.036	856.872	0,11
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	1.200.000	USD	1.190.209	1.185.930	0,15
CH0441186514	Scotiabk 0.2% 18-19.11.25	2.000.000	CHF	2.000.000	2.030.500	0,26
CH0295653577	Scotiabk 0.3% 15-16.09.22	4.500.000	CHF	4.566.700	4.487.625	0,57
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	400.000	EUR	453.568	399.455	0,05
				<b>27.674.078</b>	<b>28.573.231</b>	<b>3,65</b>
<b>Luxembourg</b>						
CH0398677689	Aroundtown 0.732% 18-30.01.25	3.600.000	CHF	3.600.000	3.422.700	0,44
XS0241594778	Bei 1.9% 06-26.01.26	950.000.000	JPY	10.255.665	9.605.699	1,23
XS0282506657	Bei 2.15% 07-18.1.27 Senior	300.000.000	JPY	3.692.678	3.137.004	0,40
US298785DV50	Bei 4.875% 06-15.02.36	5.000.000	USD	5.442.929	7.237.760	0,92
XS0093667334	Bei 5.625% 98-15.02.28	1.200.000	EUR	2.097.919	1.846.039	0,24
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	200.000	EUR	221.340	194.952	0,02
				<b>25.310.531</b>	<b>25.444.154</b>	<b>3,25</b>
<b>Mexique</b>						
US191241AH15	Coca Co F 2.75% 20-22.01.30	500.000	USD	480.212	472.034	0,06
				<b>480.212</b>	<b>472.034</b>	<b>0,06</b>
<b>Pays-Bas</b>						
CH0441004402	Achmea Hypo 0.5% 18-15.11.22	1.700.000	CHF	1.701.003	1.707.650	0,22
DE000A28RSR6	Allianz Fin 0.50% 20-14.01.31 Regs	800.000	EUR	859.871	778.322	0,10
CH0241528741	Bng 1.25% 14-30.04.24	4.000.000	CHF	4.340.400	4.257.000	0,54
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	3.000.000	CHF	3.003.750	2.763.750	0,35
USN30707AJ75	Enel Fin 4.25% 18-14.09.23 Regs	3.000.000	USD	2.866.298	2.984.331	0,38
XS0177089298	Enel Inv 5.25% 03-29.09.23	4.000.000	EUR	7.178.632	4.891.168	0,62

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	400.000	EUR	456.400	428.905	0,05
CH0026620846	Rabobk 3.125% 06-15.09.26	2.000.000	CHF	2.459.100	2.274.500	0,29
US21685WDD65	Rabobk 3.875% 12-08.02.22	9.000.000	USD	8.196.691	8.958.046	1,15
XS2049616621	Siemens Fin 0.125% 19-5.9.29	500.000	EUR	541.977	481.944	0,06
US879385AD49	Telefonica 8.25% 00-15.9.30	4.000.000	USD	5.188.253	5.396.319	0,69
				<b>36.792.375</b>	<b>34.921.935</b>	<b>4,45</b>
	<b>Nigéria</b>					
CH0511762038	Africa Fina 0.522% 19-20.12.23	1.500.000	CHF	1.500.000	1.413.750	0,18
				<b>1.500.000</b>	<b>1.413.750</b>	<b>0,18</b>
	<b>Autriche</b>					
XS0782697071	Oebb Inf 3.375% 12-18.5.32	500.000	EUR	654.431	734.329	0,09
CH0020632144	Oekb 2.875% 05-25.02.30	5.000.000	CHF	5.135.500	6.406.250	0,82
				<b>5.789.931</b>	<b>7.140.579</b>	<b>0,91</b>
	<b>Philippines</b>					
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	840.000.000	JPY	8.160.089	8.961.057	1,15
				<b>8.160.089</b>	<b>8.961.057</b>	<b>1,15</b>
	<b>Pologne</b>					
CH0385997074	Pko Bank 0.3% 17-02.11.21	7.500.000	CHF	7.548.850	7.387.500	0,94
				<b>7.548.850</b>	<b>7.387.500</b>	<b>0,94</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	200.000	EUR	226.613	219.718	0,03
				<b>226.613</b>	<b>219.718</b>	<b>0,03</b>
	<b>Suède</b>					
CH0406415304	Lansbk 0.2% 18-17.04.26	2.000.000	CHF	1.996.900	2.035.000	0,26
XS0191154961	Vattenf Tsy 5.375% 04-29.04.24	4.000.000	EUR	6.209.922	5.018.523	0,64
				<b>8.206.822</b>	<b>7.053.523</b>	<b>0,90</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0506668869	Ubs Group F 3% 19-perp	1.000.000	CHF	1.000.000	892.500	0,11
CH0525158371	Zuerich Ver 0.10% 20-27.08.32	2.000.000	CHF	2.008.720	1.820.000	0,24
				<b>3.008.720</b>	<b>2.712.500</b>	<b>0,35</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	700.000	EUR	748.871	719.534	0,09
XS2076079594	Bco Sab 0.625% 19-07.11.25	1.000.000	EUR	1.088.961	984.432	0,13
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	400.000	EUR	444.730	404.771	0,05
CH0438965540	Santan Cons 0.625% 18-24.10.22	2.000.000	CHF	2.001.980	1.944.500	0,25
XS1767931121	Santand 2.125% 18-8.2.28 Regs	500.000	EUR	532.218	481.276	0,06
CH0505011947	Santander 0.20% 19-19.11.27	1.000.000	CHF	1.000.000	893.750	0,11
CH0367206684	Santander 0.75% 17-12.06.23	5.000.000	CHF	5.081.350	4.836.250	0,62
XS1751004232	Santander 1.125% 18-17.01.25	1.500.000	EUR	1.656.389	1.526.300	0,20
				<b>12.554.499</b>	<b>11.790.813</b>	<b>1,51</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Corée du Sud</b>						
CH0506668851	Eibk 0% 19-27.05.25	1.000.000	CHF	1.007.390	955.000	0,12
CH0419040917	Hyucap 0.7325% 19-26.02.24	2.000.000	CHF	2.000.000	1.958.500	0,25
CH0461238856	Kor Railrd 0.0% 19-19.11.24	1.000.000	CHF	1.009.050	979.250	0,13
				<b>4.016.440</b>	<b>3.892.750</b>	<b>0,50</b>
<b>Venezuela</b>						
CH0204567322	Corp Andina 1.375% 13-11.02.21	2.000.000	CHF	2.067.100	2.011.500	0,26
				<b>2.067.100</b>	<b>2.011.500</b>	<b>0,26</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	400.000	USD	407.147	426.496	0,05
CH0314209369	Amgen 0.41% 16-08.03.23	2.500.000	CHF	2.527.600	2.512.500	0,32
CH0271171685	Apple Inc 0.375% 15-25.11.24	3.000.000	CHF	3.043.900	3.038.250	0,39
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	1.350.000	EUR	1.472.321	1.340.104	0,17
US037833DN70	Apple Inc 2.05% 19-11.09.26	400.000	USD	391.877	397.810	0,05
CH0260769424	At&t Inc 1.375% 14-04.12.24	3.400.000	CHF	3.591.180	3.466.300	0,44
CH0474977722	Bac 0.252% 19-12.06.26	2.000.000	CHF	2.000.000	1.871.000	0,24
US059438AK79	Banc One 8% 97-29.4.27	7.000.000	USD	11.239.676	8.640.973	1,09
XS1079726334	Bank Of Ame 2.375% 14-19.06.24	1.000.000	EUR	1.057.477	1.091.923	0,14
CH0365501474	Citigp 0.5% 17-22.11.24	2.000.000	CHF	1.971.099	1.932.000	0,25
CH0026791225	Citigp 3.125% 06-27.09.21	5.000.000	CHF	5.058.206	5.148.750	0,66
CH0467182405	Citigroup I 0.75% 19-02.04.26	5.000.000	CHF	5.053.780	4.800.000	0,61
CH0297974898	Coca Cola 1% 15-02.10.28	15.000.000	CHF	15.863.901	15.705.001	2,00
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	1.000.000	USD	953.467	916.686	0,12
CH0323735594	Eli Lilly 0.15% 16-24.05.24	10.000.000	CHF	9.985.100	9.905.000	1,26
US36962GXZ26	Gecc 6.75% 02-15.3.32 Mtn	4.500.000	USD	6.607.911	5.243.668	0,67
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	800.000	EUR	865.874	811.827	0,10
CH0379268672	Gs 0.5% 17-04.12.24	8.000.000	CHF	7.998.500	7.634.000	0,98
CH0417086045	Gs 1% 18-24.11.25 -h- Regs	2.000.000	CHF	2.013.100	1.904.500	0,24
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	1.250.000	USD	1.222.750	1.077.827	0,14
US428236BQ57	Hp 4.375% 11-15.9.21	3.500.000	USD	3.325.028	3.444.130	0,44
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	4.500.000	USD	4.826.808	6.380.970	0,82
US459056LD78	Ibrd 7.625% 93-19.01.23	12.000.000	USD	19.950.133	13.878.503	1,76
XS0099196197	Intl Finance 5.375% 99-7.12.28	2.000.000	GBP	3.717.641	3.337.220	0,43
CH0517825268	Jackson Nat 0.125% 20-14.07.28	1.000.000	CHF	1.000.850	900.250	0,12
CH0423233565	Jackson Nat 0.3% 18-18.12.23	1.000.000	CHF	999.550	983.000	0,13
CH0272024669	Jpm 0.5% 15-04.12.23	7.000.000	CHF	7.124.700	6.945.750	0,89
US58013MEH34	Mc Donald S 5.7% 09-1.2.39	3.000.000	USD	2.781.402	3.641.405	0,47
CH0338330456	Mcdonalds 0.17% 16-04.10.24	5.000.000	CHF	4.982.600	4.923.750	0,63
US58013MFM10	Mcdonalds 2.125% 20-01.03.30	400.000	USD	382.014	359.882	0,05
US58013MEL46	Mcdonalds 3.625% 11-20.5.21	3.000.000	USD	2.819.534	2.967.932	0,38
CH0482172340	Met Life 0.125% 19-11.06.27	4.000.000	CHF	4.000.000	3.801.000	0,49
CH0254282202	Met Life 1% 14-19.09.22	8.000.000	CHF	8.358.500	7.944.000	1,02
XS1110874820	Met Life 1.25% 14-17.09.21	3.000.000	EUR	3.039.804	3.185.190	0,41
CH0360172693	Mondelez 0.617% 17-30.09.24	2.000.000	CHF	1.995.100	1.953.500	0,25
CH0274758827	Mondelez 0.625% 15-30.12.21	5.580.000	CHF	5.664.916	5.599.530	0,72
CH0423233540	North Am 0.3% 18-24.07.26	700.000	CHF	700.826	715.050	0,09
CH0471297959	Ny Life Gbl 0.25% 19-18.10.27 Regs	2.000.000	CHF	2.006.960	1.917.000	0,24

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

## Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	1.250.000	EUR	1.362.068	1.114.117	0,14
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	300.000	USD	295.420	304.479	0,04
US9128283R96	Usa 0.5% 18-15.01.28 /infl	10.000.000	USD	9.149.813	10.586.802	1,34
US912828F213	Usa 2.125% 14-30.09.21 /tbo	3.000.000	USD	2.897.963	2.984.628	0,38
XS1030900242	Verizon Com 3.25% 14-17.02.26	5.000.000	EUR	6.540.228	5.843.666	0,75
CH0367206668	Verizon 0.375% 17-31.05.23 Regs	6.000.000	CHF	6.030.100	5.944.500	0,76
				<b>187.276.824</b>	<b>177.520.869</b>	<b>22,67</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>508.438.041</b>	<b>481.507.266</b>	<b>61,53</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	882	EUR	104.101	48.083	0,01
				<b>104.101</b>	<b>48.083</b>	<b>0,01</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	6.947	GBP	71.492	46.406	0,01
				<b>71.492</b>	<b>46.406</b>	<b>0,01</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	4.091	USD	23.817	20.068	0,00
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	3.314	USD	101.938	76.314	0,01
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	832	USD	107.294	82.939	0,01
US6819361006	Omega Healthcare Investors	3.276	USD	130.559	84.124	0,00
US8666741041	Sun Communities Inc	393	USD	60.419	47.474	0,01
US92276F1003	Ventas Inc.	2.228	USD	161.709	57.773	0,01
				<b>585.736</b>	<b>368.692</b>	<b>0,04</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>761.329</b>	<b>463.181</b>	<b>0,06</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>637.082.686</b>	<b>611.356.240</b>	<b>78,12</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
US110709DL37	Brit.columbia 6.5% 96-15.01.26	10.000.000	USD	12.785.913	12.596.537	1,61
				<b>12.785.913</b>	<b>12.596.537</b>	<b>1,61</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
USU52932BB29	Liberty Mut 4.569% 19-01.02.29	1.850.000	USD	1.778.468	1.977.823	0,25
				<b>1.778.468</b>	<b>1.977.823</b>	<b>0,25</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>14.564.381</b>	<b>14.574.360</b>	<b>1,86</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>14.564.381</b>	<b>14.574.360</b>	<b>1,86</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00BVXBYN70	Gam St Chf -ins- /cap	2.868.481	CHF	28.609.073	30.104.708	3,85
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	1.354.804	USD	9.133.901	8.710.539	1,11
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	534.962	USD	25.372.361	24.565.421	3,14
				<b>63.115.335</b>	<b>63.380.668</b>	<b>8,10</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	150.823	USD	17.359.686	16.384.890	2,09
LU1637934073	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Chf	230.220	CHF	22.172.468	21.741.957	2,78
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	42.497	USD	4.342.621	3.689.928	0,47
				<b>43.874.775</b>	<b>41.816.775</b>	<b>5,34</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>106.990.110</b>	<b>105.197.443</b>	<b>13,44</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>106.990.110</b>	<b>105.197.443</b>	<b>13,44</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>758.637.177</b>	<b>731.128.043</b>	<b>93,42</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Etats-Unis d'Amérique	24,14	Banques et autres institutions financières	20,05
Suisse	13,59	Fonds d'investissements	13,44
Irlande	8,80	Holdings et sociétés financières	10,46
Luxembourg	8,59	Obligations d'Etats et de villes étrangers	10,27
Canada	5,62	Supranational	9,79
Pays-Bas	4,55	Pharmacie et cosmétique	6,34
France	3,87	Alimentation, boissons	5,97
Royaume-Uni	3,86	Transmission de nouvelles	3,19
Australie	2,80	Assurances	2,13
Allemagne	2,73	Electrotechnique, électronique	1,79
Italie	1,90	Energie et service des eaux	1,62
Espagne	1,57	Gastronomie	1,54
Japon	1,50	Articles de bureau et ordinateurs	1,18
Côte d'Ivoire	1,48	Chimie	0,87
Philippines	1,15	Construction, matériel de construction	0,80
Danemark	1,01	Circulation et transport	0,71
Pologne	0,94	Sociétés immobilières	0,65
Autriche	0,91	Mécanique, outillage	0,50
Suède	0,90	Commerce de détail et grands magasins	0,39
Chili	0,89	Biotechnologie	0,33
Jersey	0,66	Santé, éducation et services sociaux	0,26
Corée du Sud	0,50	Internet Software	0,27
Bermudes	0,45	Services divers	0,25
Chine	0,40	Pétrole	0,14
Venezuela	0,26	Véhicules routiers	0,06
Nigéria	0,18	Industrie horlogère	0,07
Mexique	0,06	Arts graphiques et maisons d'édition	0,08
Portugal	0,04	Biens de consommation divers	0,06
Liechtenstein	0,03	Textile et habillement	0,04
Finlande	0,02	Industrie aéronautique et spatiale	0,03
Belgique	0,02	Métaux non ferreux	0,03
	<b>93,42</b>	Papier et bois	0,02
		Caoutchouc et pneus	0,02
		Agriculture et pêche	0,01
		Maisons de commerce diverses	0,01
		Divers	0,01
		Mines, aciéries	0,01
		Photographie et optique	0,01
		Service d'environnement et de recyclage	0,01
		Métaux et pierres précieuses	0,01
			<b>93,42</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0974264930	Ageas Nv	4.458	EUR	235.676	169.003	0,10
BE0003818359	Galapagos Genomics Nv	452	EUR	72.082	81.812	0,04
BE0003565737	Kbc Groupe Sa	941	EUR	43.998	39.541	0,02
BE0003826436	Telenet Group Holding	2.726	EUR	130.846	74.801	0,04
BE0003739530	Ucb	1.867	EUR	138.264	147.493	0,08
BE0974320526	Umicore Sa	645	EUR	21.869	20.543	0,01
				<b>642.735</b>	<b>533.193</b>	<b>0,29</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG169621056	Bunge Ltd	527	USD	17.823	19.706	0,01
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	712	USD	38.260	38.934	0,02
				<b>56.083</b>	<b>58.640</b>	<b>0,03</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	1.368	EUR	335.121	281.671	0,15
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	2.779	EUR	537.321	435.969	0,24
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	1.280	EUR	131.388	118.477	0,07
DE0005190003	Bmw-bayer.motorenwerke	2.296	EUR	168.109	108.176	0,06
DE000A1DAH00	Brenntag	929	EUR	30.420	31.428	0,02
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	1.054	EUR	103.205	93.121	0,05
DE000CBK1001	Commerzbank Akt Nach Kap	3.689	EUR	13.686	12.205	0,01
DE0005439004	Continental Ag	1.012	EUR	67.834	66.397	0,04
DE0006062144	Covestro Ag	4.393	EUR	219.057	122.433	0,07
DE0007100000	Daimler Ag / Namen-akt.	1.638	EUR	48.762	45.078	0,02
DE000A2E4K43	Delivery Hero Se	210	EUR	15.349	14.272	0,01
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	11.003	EUR	70.793	65.677	0,04
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	1.723	EUR	218.620	215.375	0,12
DE0005552004	Deutsche Post Ag	4.502	EUR	134.149	111.537	0,06
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	24.161	EUR	297.864	285.438	0,16
DE000ENAG999	E.on Se	10.168	EUR	90.112	95.996	0,05
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-	5.416	EUR	144.323	103.283	0,06
DE0005785604	Fresenius Se & Co Kгаа	1.701	EUR	57.162	57.715	0,03
DE0006602006	Gea Group Ag	2.627	EUR	72.413	49.191	0,03
DE0006047004	Heidelbergcement Ag	3.268	EUR	201.573	127.746	0,07
DE0006048432	Henkel / Vorzug	2.518	EUR	234.310	184.318	0,10
DE0006070006	Hochtief Ag	991	EUR	131.412	59.956	0,03
DE000KGX8881	Kion Group	2.469	EUR	154.286	97.377	0,05
DE0005470405	Lanxess Ag	1.541	EUR	54.883	56.123	0,03
DE0006599905	Merck Kгаа	1.504	EUR	140.013	140.804	0,08
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	1.245	EUR	238.167	229.205	0,13
DE0006969603	Puma Se	1.754	EUR	93.374	95.418	0,05
DE0007164600	Sap Se	5.562	EUR	500.016	571.773	0,30
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	5.155	EUR	564.801	399.358	0,22
DE000SHL1006	Siemens Healthineers Ag	626	EUR	26.500	22.564	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
DE000SYM9999	Symrise Ag	1.208	EUR	118.837	102.680	0,06
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	38.194	EUR	121.469	86.280	0,05
DE000UNSE018	Uniper Se	1.282	EUR	33.286	28.832	0,02
DE000A1ML7J1	Vonovia Se /namen	936	EUR	41.415	41.989	0,02
				<b>5.410.030</b>	<b>4.557.862</b>	<b>2,51</b>
	<b>Finlande</b>					
FI0009007132	Fortum Corporation	7.838	EUR	151.503	104.833	0,06
FI0009013403	Kone Oyj -b-	544	EUR	26.013	28.081	0,02
FI0009007835	Metso Corp	5.513	EUR	167.854	119.743	0,06
FI0009013296	Neste Oil Oyj	3.745	EUR	119.030	115.533	0,06
FI0009000681	Nokia Oy	36.418	EUR	103.588	104.483	0,06
FI0009014377	Orion Corp (new)- Shs-b-	1.732	EUR	66.605	64.569	0,04
				<b>634.593</b>	<b>537.242</b>	<b>0,30</b>
	<b>France</b>					
FR0000120073	Air Liquide	3.222	EUR	357.845	375.846	0,21
FR0010313833	Arkema	209	EUR	12.617	13.167	0,01
FR0000051732	Atos Act.	636	EUR	39.977	39.267	0,02
FR0000120628	Axa	15.762	EUR	314.042	248.850	0,14
FR0000131104	Bnp Paribas	8.882	EUR	335.980	244.344	0,13
FR0000039299	Bolloré Sa	33.920	EUR	130.486	85.139	0,05
FR0000120503	Bouygues	3.808	EUR	148.208	101.750	0,06
FR0006174348	Bureau Veritas	4.377	EUR	108.848	75.766	0,04
FR0000125338	Capgemini Se	1.292	EUR	94.017	99.484	0,05
FR0000120222	Cnp Assurances	11.581	EUR	221.585	103.303	0,06
FR0000120644	Danone.	4.605	EUR	271.781	270.037	0,15
FR0010242511	Edf	4.041	EUR	30.403	29.039	0,02
FR0000130452	Eiffage Sa	1.549	EUR	140.252	99.911	0,05
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	2.255	EUR	318.789	221.621	0,12
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	8.472	EUR	150.612	80.704	0,04
FR0010533075	Getlink Se	3.171	EUR	34.768	34.849	0,02
FR0000052292	Hermes International	291	EUR	204.283	182.981	0,10
FR0010259150	Ipsen	546	EUR	26.006	25.760	0,01
FR0000121485	Kering Sa	542	EUR	293.438	257.938	0,14
FR0000120321	L Oreal	1.670	EUR	402.688	398.963	0,22
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	2.888	EUR	200.079	168.890	0,09
FR0000121261	Michelin B /nom.	1.943	EUR	156.631	157.500	0,09
FR0000133308	Orange	4.035	EUR	46.265	44.930	0,02
FR0000121501	Peugeot Sa	3.508	EUR	43.284	42.675	0,02
FR0000125007	Saint-gobain	7.709	EUR	250.881	170.870	0,09
FR0000120578	Sanofi	7.023	EUR	538.842	562.822	0,32
FR0000121972	Schneider Electric Se	4.029	EUR	393.003	316.599	0,17
FR0000121220	Sodexo	552	EUR	54.876	34.025	0,02
FR0000130809	Ste Gen.paris -a-	5.736	EUR	99.557	88.036	0,05
FR0010613471	Suez Environnement Cie	11.069	EUR	130.908	102.676	0,06
FR0000051807	Teleperform.se	787	EUR	178.422	149.373	0,08
FR0000120271	Total Sa	15.530	EUR	754.898	549.606	0,30
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	671	EUR	41.989	45.078	0,02
FR0000124141	Veolia Environnement	7.207	EUR	169.347	140.356	0,08

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000125486	Vinci.	1.609	EUR	127.648	121.319	0,07
				<b>6.823.255</b>	<b>5.683.474</b>	<b>3,12</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
GB0006731235	Associated British Foods Plc	4.556	GBP	142.909	93.394	0,05
GB0009895292	Astrazeneca Plc	840	GBP	63.412	68.497	0,04
GB0031348658	Barclays Plc	28.918	GBP	33.380	30.754	0,02
GB0007980591	Bp Plc	22.863	GBP	84.675	88.929	0,05
GB0031743007	Burberry Group Plc	2.679	GBP	39.597	40.098	0,02
GB00B033F229	Centrica Plc	32.749	GBP	15.717	14.093	0,01
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	1.428	GBP	17.437	20.397	0,01
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	5.625	GBP	91.433	96.276	0,05
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	4.109	GBP	22.863	21.093	0,01
GB0031274896	Marks And Spencer /new	36.003	GBP	79.819	40.376	0,02
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	64.708	GBP	120.366	66.908	0,04
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	11.345	GBP	108.374	51.282	0,03
GB0032089863	Next Plc	337	GBP	23.498	15.507	0,01
GB0006825383	Persimmon Plc	2.206	GBP	74.111	47.776	0,03
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	214	GBP	13.427	14.873	0,01
GB00B2B0DG97	Relx Plc	5.283	GBP	99.012	103.402	0,06
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	2.346	GBP	97.791	98.581	0,05
GB00B8C3BL03	Sage Grp	3.790	GBP	24.301	25.346	0,01
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	2.563	GBP	39.574	41.548	0,02
GB0004082847	Standard Chartered Plc	8.757	GBP	45.237	44.116	0,02
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	74.023	GBP	122.446	98.289	0,05
GB00B10RZP78	Unilever Plc	2.746	GBP	147.382	126.467	0,08
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	86.540	GBP	160.736	110.508	0,06
				<b>1.667.497</b>	<b>1.358.510</b>	<b>0,75</b>
	<b>Irlande</b>					
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	716	USD	123.724	106.534	0,06
IE00BY9D5467	Allergan Plc	147	USD	22.937	23.726	0,01
IE00BD1RP616	Bank Of Ireland Group Plc	13.727	EUR	27.178	23.665	0,01
IE0001827041	Crh Plc	5.732	EUR	161.116	142.440	0,07
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	286	USD	19.699	20.250	0,01
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	2.122	USD	80.752	52.139	0,03
IE0004906560	Kerry Group A	120	EUR	11.813	12.624	0,01
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	1.234	USD	103.547	101.419	0,06
IE00BLS09M33	Pentair Plc	572	USD	15.321	15.514	0,01
IE00B58JVZ52	Seagate Technologie Plc	376	USD	18.561	16.723	0,01
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	4.713	EUR	157.535	121.218	0,07
				<b>742.183</b>	<b>636.252</b>	<b>0,35</b>
	<b>Italie</b>					
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	12.607	EUR	223.947	156.453	0,09
IT0003128367	Enel	44.036	EUR	218.951	279.143	0,14
IT0003132476	Eni Spa Roma	24.789	EUR	351.921	228.555	0,13
NL0011585146	Ferrari N.v.	968	EUR	135.444	137.020	0,08
IT0000072618	Intesa Sanpaolo Spa	28.366	EUR	45.898	42.220	0,02



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IT0000062957	Mediobanca Bca Credito Finanz.	3.277	EUR	17.565	16.477	0,01
IT0003796171	Poste Italiane Spa	13.043	EUR	132.732	100.692	0,06
IT0003497176	Telecom Italia Spa/risp.n-cv	169.050	EUR	85.925	60.943	0,03
IT0005239360	Unicredit Spa	8.202	EUR	69.247	58.620	0,03
				<b>1.281.630</b>	<b>1.080.123</b>	<b>0,59</b>
	<b>Japon</b>					
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	1.300	JPY	30.698	29.237	0,02
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	2.200	JPY	34.077	37.340	0,02
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	7.900	JPY	102.844	111.444	0,06
JP3220580009	Calbee Inc	800	JPY	18.327	19.728	0,01
JP3566800003	Central Japan Railway Co	100	JPY	15.038	14.622	0,01
JP3511800009	Chiba Bank	8.800	JPY	44.903	35.139	0,02
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	4.600	JPY	108.593	89.357	0,05
JP3551500006	Denso Corp	1.500	JPY	45.151	44.207	0,02
JP3160400002	Eisai Co.ltd	600	JPY	37.747	40.173	0,02
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	5.200	JPY	86.125	85.076	0,05
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	100	JPY	41.792	37.306	0,02
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	1.800	JPY	36.822	37.215	0,02
JP3818000006	Fujitsu Ltd	600	JPY	48.110	49.412	0,03
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	3.000	JPY	28.908	27.606	0,02
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	900	JPY	48.548	60.631	0,03
JP3788600009	Hitachi Ltd	5.200	JPY	169.859	137.974	0,08
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	3.300	JPY	70.925	67.697	0,04
JP3837800006	Hoya Corp	200	JPY	14.879	15.534	0,01
JP3386030005	Jfe Holdings Inc	1.900	JPY	13.318	11.276	0,01
JP3292200007	Jtekt Corp	3.000	JPY	20.407	18.615	0,01
JP3496400007	Kddi Corp.	3.400	JPY	91.329	91.563	0,05
JP3982100004	Lawson Inc	1.600	JPY	82.522	80.099	0,04
JP3626800001	Lixil Group Shs	8.100	JPY	125.653	91.973	0,05
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	2.100	JPY	11.825	11.396	0,01
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	5.300	JPY	74.432	71.365	0,04
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	1.100	JPY	17.636	17.370	0,01
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	4.500	JPY	138.888	114.918	0,06
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	100	JPY	34.822	35.128	0,02
JP3743000006	Nippon Meat Packers	1.200	JPY	37.483	38.142	0,02
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	3.200	JPY	46.557	48.681	0,03
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	1.900	JPY	93.697	77.393	0,04
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	5.600	JPY	116.756	82.969	0,05
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	4.000	JPY	97.357	114.036	0,06
JP3200450009	Orix Corp	3.600	JPY	41.684	39.524	0,02
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	600	JPY	19.636	21.431	0,01
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	1.300	JPY	103.018	117.758	0,06
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	700	JPY	39.211	31.421	0,02
JP3435000009	Sony Corp	2.700	JPY	167.737	146.358	0,08
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	12.900	JPY	35.164	34.958	0,02
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	3.300	JPY	104.365	87.032	0,05
JP3336560002	Suntory B & F	2.300	JPY	77.941	79.318	0,04
JP3544000007	Teijin Ltd	1.600	JPY	26.575	24.719	0,01
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	2.500	JPY	126.582	104.471	0,06



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	100	JPY	17.540	17.184	0,01
JP3592200004	Toshiba Corp	1.100	JPY	22.767	22.101	0,01
JP3633400001	Toyota Motor Corp	700	JPY	40.129	38.418	0,02
				<b>2.808.377</b>	<b>2.609.315</b>	<b>1,44</b>
	<b>Jersey</b>					
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	728	GBP	40.202	41.595	0,02
				<b>40.202</b>	<b>41.595</b>	<b>0,02</b>
	<b>Canada</b>					
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	2.591	CAD	29.220	26.129	0,01
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	2.439	CAD	54.304	60.859	0,03
CA05534B7604	Bce Inc	1.932	CAD	81.343	71.415	0,04
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	4.356	CAD	111.165	53.691	0,03
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	1.339	CAD	131.549	72.824	0,04
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	3.028	CAD	58.799	65.222	0,04
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	1.131	CAD	63.376	55.175	0,03
CA1254911003	Ci Financial Corp	9.363	CAD	148.379	83.752	0,05
CA2908761018	Emera Inc	502	CAD	16.331	17.839	0,01
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	4.905	CAD	83.073	86.463	0,05
CA9611485090	George Weston Ltd	781	CAD	47.745	50.322	0,03
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	4.037	CAD	136.498	114.356	0,06
CA45823T1066	Intact Fin	166	CAD	12.739	12.928	0,01
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	1.435	CAD	43.050	38.085	0,02
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	348	CAD	16.451	16.166	0,01
CA5592224011	Magna International Inc	1.292	CAD	36.247	37.153	0,02
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	11.919	CAD	216.165	134.854	0,07
CA6837151068	Open Text Corp	2.079	CAD	91.267	65.507	0,04
CA7392391016	Power Corp.canada	6.323	CAD	135.991	91.661	0,05
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	1.497	CAD	60.231	54.358	0,03
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	430	CAD	23.573	24.000	0,01
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	1.816	CAD	83.408	52.639	0,03
CA8672241079	Suncor Energy	4.236	CAD	52.136	60.918	0,03
CA92938W2022	Wsp Global Inc	305	CAD	14.401	15.608	0,01
				<b>1.747.441</b>	<b>1.361.924</b>	<b>0,75</b>
	<b>Liechtenstein</b>					
LI0355147575	Liechtenst	287	CHF	15.789	14.598	0,01
				<b>15.789</b>	<b>14.598</b>	<b>0,01</b>
	<b>Luxembourg</b>					
LU0156801721	Tenaris Sa	3.195	EUR	17.198	17.828	0,01
				<b>17.198</b>	<b>17.828</b>	<b>0,01</b>
	<b>Pays-Bas</b>					
NL0012969182	Adyen B.v.	113	EUR	92.665	87.078	0,05
NL0013267909	Akzo Nobel	1.555	EUR	87.357	93.316	0,05
NL0010273215	Asml Holding Nv	2.610	EUR	546.868	632.794	0,34
NL0012059018	Exor N.v.	2.860	EUR	173.918	134.420	0,07

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.v	6.433	EUR	43.970	42.278	0,02
NL0011821202	Ing Group Nv	5.503	EUR	44.169	26.313	0,01
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.v.	518	EUR	36.395	35.587	0,02
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	9.007	EUR	121.953	191.714	0,11
NL0000009827	Koninklijke Dsm Nv	174	EUR	17.243	18.009	0,01
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	13.091	EUR	33.799	28.486	0,02
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	7.175	EUR	231.616	264.864	0,15
NL0009538784	Nxp Semiconductor	2.143	USD	194.255	161.968	0,09
NL0013654783	Prosus Bearer Rg Shs -n-	1.858	EUR	118.447	117.333	0,06
NL0000379121	Randstad Holding (eur 0.1)	1.655	EUR	52.173	53.241	0,03
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	8.213	EUR	146.217	163.233	0,09
NL0000388619	Unilever Nv.	9.566	EUR	487.723	428.604	0,24
NL0000395903	Wolters Kluwer Nv	2.764	EUR	157.728	177.394	0,10
				<b>2.586.496</b>	<b>2.656.632</b>	<b>1,46</b>
<b>Autriche</b>						
AT0000730007	Andritz Ag Graz	572	EUR	15.629	16.348	0,01
AT0000652011	Erste Group Bank Ag	2.802	EUR	53.989	47.312	0,03
				<b>69.618</b>	<b>63.660</b>	<b>0,04</b>
<b>Portugal</b>						
PTBES0AM0007	Banco Espirito Santo Sa/reg	236.600	EUR	209.922	0	0,00
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	14.896	EUR	49.291	54.490	0,03
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	7.512	EUR	98.458	78.087	0,04
				<b>357.671</b>	<b>132.577</b>	<b>0,07</b>
<b>Suisse</b>						
CH0012221716	Abb	6.599	CHF	111.918	105.700	0,06
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	1.184	CHF	71.232	42.536	0,02
CH0432492467	Alcon Inc.	1.017	CHF	37.794	47.256	0,03
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	1.810	CHF	25.334	9.292	0,01
CH0012410517	Baloise Holding/namen	364	CHF	46.421	43.509	0,02
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	20	CHF	32.256	36.547	0,02
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	8	CHF	28.091	47.172	0,03
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	10.915	CHF	191.960	82.250	0,05
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	29	CHF	10.761	18.274	0,01
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	22	CHF	26.767	24.266	0,01
CH0114405324	Garmin	1.280	USD	118.273	87.445	0,05
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	143	CHF	53.752	57.381	0,03
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	21	CHF	38.724	59.243	0,03
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	28	CHF	21.534	30.383	0,02
CH0023868554	Implenia Ag	456	CHF	30.819	14.690	0,01
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	45	CHF	23.349	26.704	0,01
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	1.728	CHF	78.112	57.554	0,03
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	355	CHF	22.682	22.270	0,01
CH0108503795	Meyer Burger	15.898	CHF	23.080	2.308	0,00
CH0038863350	Nestle / Act Nom	6.437	CHF	336.470	602.989	0,33
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	6.433	CHF	349.265	483.848	0,27
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	1.989	CHF	364.666	588.375	0,32

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0024638196	Schindler Holding/partic	295	CHF	53.144	59.020	0,03
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	20	CHF	20.973	17.690	0,01
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	4.246	CHF	38.588	57.912	0,03
CH0418792922	Sika Ltd	300	CHF	32.585	45.199	0,02
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	401	CHF	52.820	65.874	0,04
CH0002178181	Stadler Rail Ag	320	CHF	10.736	13.473	0,01
CH0126881561	Swiss Re-namen	1.670	CHF	124.744	117.285	0,06
CH0008742519	Swisscom /nam.	212	CHF	92.020	103.879	0,06
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	706	CHF	45.509	25.323	0,01
CH0244767585	Ubs Group Ag	14.402	CHF	221.280	122.716	0,07
CH0311864901	Vat Group Ltd	220	CHF	22.988	27.768	0,02
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	53	CHF	2.655	2.376	0,00
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	519	CHF	130.457	167.876	0,09
				<b>2.891.759</b>	<b>3.316.383</b>	<b>1,82</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0167050915	Acs	87	EUR	0	1.550	0,00
ES0105046009	Aena Sme Sa	1.080	EUR	188.101	107.482	0,06
ES0109067019	Amadeus It --- Shs-a-	454	EUR	21.423	19.613	0,01
ES0113900J37	Banco Santander --- Reg.shs	53.609	EUR	225.366	118.905	0,07
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	61.930	EUR	202.139	180.557	0,10
ES0130960018	Enagas	5.449	EUR	135.797	98.600	0,05
ES0130670112	Endesa Sa	6.088	EUR	144.783	118.533	0,07
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	39.567	EUR	283.070	355.469	0,19
ES0148396007	Inditex	9.312	EUR	248.301	220.322	0,12
ES0173093024	Red Electrica Corporacion. Sa	2.099	EUR	31.070	34.350	0,02
ES0173516115	Repsol Sa	21.285	EUR	270.508	177.347	0,10
ES0178430E18	Telefonica Sa	7.414	EUR	32.997	30.942	0,02
				<b>1.783.555</b>	<b>1.463.670</b>	<b>0,81</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US00287Y1091	Abbvie Inc	645	USD	48.691	44.787	0,02
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	193	USD	9.421	10.462	0,01
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	617	USD	39.699	51.446	0,03
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	78	USD	79.335	82.599	0,05
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	80	USD	82.102	84.780	0,05
US0231351067	Amazon Com Inc	105	USD	179.560	186.576	0,10
US0258161092	American Express Co.	523	USD	56.359	40.806	0,02
US0311621009	Amgen Inc	435	USD	93.913	80.371	0,04
US0378331005	Apple Inc	1.216	USD	240.609	281.812	0,15
US0382221051	Applied Materials Inc	1.162	USD	65.935	48.524	0,03
US03965L1008	Arconic Inc	3.421	USD	94.965	50.072	0,03
US00206R1023	At & T	4.847	USD	158.552	128.767	0,07
US0865161014	Best Buy Co Inc.	497	USD	27.835	25.818	0,01
US09062X1037	Biogen Inc	72	USD	18.945	20.760	0,01
US1011371077	Boston Scientific Corp.	986	USD	27.238	29.322	0,02
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	2.132	USD	128.628	108.305	0,06
US12508E1010	Cdk Global Inc	562	USD	17.725	16.825	0,01
US1567821046	Cerner Corp	1.304	USD	86.030	74.859	0,04
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	2.355	USD	65.708	84.370	0,05

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US1729674242	Citigroup Inc	1.003	USD	56.630	38.502	0,02
US1912161007	Coca-cola Co.	3.161	USD	121.439	127.477	0,07
US20825C1045	Conocophillips	810	USD	23.139	22.737	0,01
US2310211063	Cummins Inc	277	USD	32.677	34.161	0,02
US25470F3029	Discovery Com Inc / -c-	987	USD	17.150	15.778	0,01
US2600031080	Dover Corp.	242	USD	18.007	18.513	0,01
US2774321002	Eastman Chemical Co	382	USD	16.429	16.217	0,01
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	4.786	USD	100.552	63.028	0,03
US30303M1027	Facebook Inc -a-	570	USD	82.209	86.649	0,05
US34354P1057	Flowserve Corp	723	USD	15.353	15.742	0,01
US3156161024	F5 Networks Inc.	201	USD	19.540	19.533	0,01
US3696041033	General Electric Co	2.600	USD	18.148	18.814	0,01
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	234	USD	15.050	15.943	0,01
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	78	USD	11.172	10.989	0,01
US4361061082	Hollyfrontier Corp	1.259	USD	57.432	28.123	0,02
US4364401012	Hologic Inc	653	USD	19.450	20.889	0,01
US4592001014	Ibm Corp	407	USD	39.776	41.147	0,02
US4612021034	Intuit	94	USD	20.185	19.704	0,01
US4781601046	Johnson & Johnson	1.393	USD	181.303	166.474	0,09
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	517	USD	64.960	47.580	0,03
US4878361082	Kellogg Co	541	USD	34.355	29.578	0,02
US4943681035	Kimberly Clark Corp	794	USD	100.845	92.530	0,05
US5010441013	Kroger Co.	534	USD	13.775	14.659	0,01
US5128071082	Lam Research Corp	269	USD	69.510	58.838	0,03
US5312294094	Liberty Media Corp	692	USD	32.583	19.986	0,01
US5324571083	Lilly (eli) & Co	164	USD	18.464	20.734	0,01
US5341871094	Lincoln National Corp.	715	USD	38.217	17.151	0,01
US5018892084	Lkq	1.093	USD	20.183	20.431	0,01
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	783	USD	83.780	61.405	0,03
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	409	USD	90.401	90.042	0,05
US58933Y1055	Merck	800	USD	54.805	56.097	0,03
US59156R1086	Metliffe Inc	3.996	USD	175.188	111.331	0,06
US5949181045	Microsoft Corp.	2.455	USD	237.438	352.863	0,18
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	932	USD	39.678	42.538	0,02
US61174X1090	Monster Beverage Corp	600	USD	29.726	30.764	0,02
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	122	USD	15.056	14.779	0,01
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	440	USD	19.313	18.157	0,01
US6541061031	Nike Inc B	611	USD	44.572	46.073	0,03
US65473P1057	Nisource Inc	1.012	USD	21.332	23.030	0,01
US67066G1040	Nvidia Corp.	140	USD	31.749	33.633	0,02
US6907421019	Owens Corning Inc	1.962	USD	114.396	69.396	0,04
US7010941042	Parker-hannifin	371	USD	43.341	43.864	0,02
US7170811035	Pfizer Inc.	1.022	USD	28.072	30.402	0,02
US6935061076	Ppg Industries Inc.	447	USD	35.373	34.057	0,02
US69351T1060	Ppl Corp	1.865	USD	38.278	41.949	0,02
US7458671010	Pultegroup Inc	4.784	USD	156.668	97.315	0,05
US74736K1016	Qorvo Inc	289	USD	25.867	21.237	0,01
US7475251036	Qualcomm Inc.	902	USD	72.106	55.612	0,03
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	781	USD	66.394	57.156	0,03
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	40	USD	15.872	17.801	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US7591EP1005	Regions Financial Corp	11.955	USD	172.625	97.732	0,05
US7607591002	Republic Services Inc.	490	USD	32.456	33.520	0,02
US7841171033	Sei Investments Co	393	USD	22.436	16.598	0,01
US78409V1044	S&p Global Shs	448	USD	112.316	100.052	0,06
US8716071076	Synopsys Inc.	163	USD	18.258	19.132	0,01
US8718291078	Sysco Corp.	1.355	USD	86.963	56.349	0,03
US87612E1064	Target Corp	584	USD	33.485	49.482	0,03
US8725401090	Tjx Companies Inc	2.053	USD	92.010	89.454	0,05
US89400J1079	Transunion	327	USD	19.857	19.723	0,01
US9078181081	Union Pacific Corp.	99	USD	12.149	12.725	0,01
US9130171096	United Technologies Corp	1.011	USD	89.788	86.915	0,05
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	199	USD	43.084	45.228	0,02
US91529Y1064	Unum Group	1.769	USD	44.902	24.199	0,01
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc	147	USD	14.231	13.753	0,01
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	81	USD	15.712	17.566	0,01
US92826C8394	Visa Inc -a	573	USD	85.589	84.139	0,05
US9285634021	Vmware Inc	148	USD	15.878	16.334	0,01
US9297401088	Wabtec Corp	406	USD	17.506	17.809	0,01
US9633201069	Whirlpool Corp.	483	USD	61.943	37.768	0,02
US9884981013	Yum Brands Shs	455	USD	30.612	28.418	0,02
				<b>5.240.988</b>	<b>4.769.565</b>	<b>2,62</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>34.817.100</b>	<b>30.893.043</b>	<b>16,99</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
CH0482172357	Nat Aus Bk 0.125% 19-21.06.27	500.000	CHF	446.950	448.950	0,25
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	500.000	EUR	507.279	474.959	0,26
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	100.000	USD	90.030	90.926	0,05
				<b>1.044.259</b>	<b>1.014.835</b>	<b>0,56</b>
<b>Belgique</b>						
BE0000346552	Belgium 1.25% 18-22.04.33 Regs	1.000.000	EUR	1.138.750	1.133.010	0,62
BE0000320292	Belgium 4.25% 10-28.3.41 Olo	1.000.000	EUR	1.742.260	1.713.260	0,94
BE0000291972	Belgium 5.5% 98-28.03.28 Olo	1.000.000	EUR	1.266.300	1.449.120	0,80
				<b>4.147.310</b>	<b>4.295.390</b>	<b>2,36</b>
<b>Chili</b>						
US05968AAG13	Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	200.000	USD	178.739	170.987	0,09
				<b>178.739</b>	<b>170.987</b>	<b>0,09</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	600.000	USD	532.800	583.448	0,32
				<b>532.800</b>	<b>583.448</b>	<b>0,32</b>
<b>Allemagne</b>						
XS2101357072	Fresenius 0.75% 20-15.01.28	700.000	EUR	696.598	659.120	0,36
DE0001102424	Germany 0.5% 17-15.08.27	1.500.000	EUR	1.487.504	1.624.920	0,89
DE0001135275	Germany 4% 05-04.01.37	1.300.000	EUR	1.724.060	2.246.335	1,24

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	350.000	USD	316.683	340.099	0,19
US500769BN36	Kfw 2.05% 06-16.02.26	40.000.000	JPY	334.121	384.998	0,21
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	400.000	EUR	398.544	380.248	0,21
				<b>4.957.510</b>	<b>5.635.720</b>	<b>3,10</b>
	<b>Côte d'Ivoire</b>					
XS0043037505	Afdb 7.375% 93-06.04.23	1.200.000	USD	1.108.387	1.307.494	0,72
				<b>1.108.387</b>	<b>1.307.494</b>	<b>0,72</b>
	<b>France</b>					
FR0013459757	C Fr Fi Loc 0.10% 19-13.11.29	500.000	EUR	499.405	494.090	0,27
FR0013463676	Essilor 0.75% 19-27.11.31	600.000	EUR	591.222	555.378	0,31
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	500.000	EUR	660.125	668.335	0,37
FR0013398229	Gdf Suez 3.25% 19-perp	100.000	EUR	98.646	99.321	0,05
XS0092663649	Rff 5.5% 98-01.12.21	1.100.000	GBP	1.608.982	1.342.875	0,74
XS0144628053	Sncf 5.375% 02-18.03.27	900.000	GBP	1.267.386	1.312.906	0,72
FR0013410818	Socgen 1.75% 19-22.03.29	1.500.000	EUR	1.617.585	1.422.764	0,79
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	500.000	EUR	494.335	545.760	0,30
FR0013424868	Vivendi 0.625% 19-11.06.25	400.000	EUR	399.648	390.092	0,21
				<b>7.237.334</b>	<b>6.831.521</b>	<b>3,76</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
XS0107382532	Abn Amro Bk 6.375% 00-7.12.28	500.000	GBP	746.006	700.203	0,39
CH0426621683	Barclays 1.125% 18-12.07.23	400.000	CHF	352.203	372.064	0,20
XS1873982745	Barclays 1.5% 18-03.09.23	1.000.000	EUR	996.110	962.140	0,53
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	850.000	EUR	846.303	746.836	0,41
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	500.000	EUR	517.433	579.810	0,32
XS1822828122	Glaxosmithk 1.25% 18-21.05.26	500.000	EUR	503.400	508.590	0,28
XS0204377310	Hsbc Bk 5.375%(tv)04-04.11.30	1.000.000	GBP	1.292.252	1.231.497	0,67
XS1788982996	Lloyds Bk 1.75% 18-07.09.28	500.000	EUR	513.700	468.775	0,26
US53944YAF07	Lloyds Bk 4.45% 18-08.05.25	1.000.000	USD	979.436	940.058	0,52
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	600.000	EUR	599.460	574.368	0,32
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	250.000	EUR	250.000	241.115	0,13
XS1788515606	Natwest Mark 1.75% 18-02.03.26	1.000.000	EUR	1.027.700	944.700	0,52
XS0206361221	Network Rail 4.75% 04-29.11.35	800.000	GBP	1.122.050	1.384.160	0,75
XS1382368113	Rbs Grp 2.5% 16-22.03.23	1.000.000	EUR	1.046.750	993.100	0,55
XS2016070430	Wstp 0.3% 19-25.06.24	700.000	EUR	699.447	668.409	0,37
				<b>11.492.250</b>	<b>11.315.825</b>	<b>6,22</b>
	<b>Irlande</b>					
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	400.000	EUR	397.024	369.428	0,20
XS1883355197	Abbott Il F 1.5% 18-27.9.26 Regs	400.000	EUR	404.328	403.400	0,22
XS1288894691	Swisscom Ag 1.75% 15-15.09.25	1.000.000	EUR	1.069.920	1.050.540	0,58
XS2013626010	Zurich Fina 1.625% 19-17.06.39	400.000	EUR	418.546	364.100	0,20
				<b>2.289.818</b>	<b>2.187.468</b>	<b>1,20</b>
	<b>Italie</b>					
US465410BY32	Italy 2.875% 19-17.10.29	2.000.000	USD	1.716.909	1.747.861	0,96
IT0004644735	Italy 4.5% 10-01.03.26 Btp	1.200.000	EUR	1.377.504	1.435.044	0,79



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IT0004356843	Italy 4.75% 08-01.08.23	1.500.000	EUR	1.432.500	1.704.120	0,94
US465410AH18	Italy 6.875% 93-27.09.23	1.800.000	USD	1.652.052	1.888.142	1,04
				<b>6.178.965</b>	<b>6.775.167</b>	<b>3,73</b>
<b>Japon</b>						
XS0171578502	Dbj 1.05% 03-20.06.23	20.000.000	JPY	150.797	174.637	0,10
XS0159205995	Dbj 1.7% 02-20.09.22	90.000.000	JPY	540.624	791.756	0,44
XS1758752635	Mit Ufj 0.68% 18-26.01.23 Regs	1.000.000	EUR	1.001.330	970.020	0,53
XS2004880832	Mizu Fin 0.523% 19-10.06.24	450.000	EUR	450.000	425.277	0,23
				<b>2.142.751</b>	<b>2.361.690</b>	<b>1,30</b>
<b>Canada</b>						
XS2049707180	Bk N Scot 0.125% 19-4.9.26	500.000	EUR	495.025	446.730	0,25
US064159QD10	Bk N Scotia 2.375% 19-18.01.23	100.000	USD	88.752	91.544	0,05
CA13509PGU18	Can Housing 2.55% 18-15.12.23	1.000.000	CAD	665.378	677.609	0,37
XS2025468542	Cibc 0.04% 19-09.07.27	600.000	EUR	599.952	589.272	0,32
XS1945965611	Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	861.000	EUR	909.305	913.332	0,50
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	50.000	USD	44.891	39.766	0,02
US563469UD51	Manitoba 3.05% 14-14.05.24	500.000	USD	372.429	496.172	0,27
US68323AFF66	Ontario 2.3% 19-15.06.26	1.000.000	USD	939.647	974.453	0,54
CA683234VR64	Ontario 5.6% 04-2.6.35 Dmtn119	1.000.000	CAD	984.793	905.799	0,50
CA74814ZFF59	Quebec Prov 2.3% 19-01.09.29	1.000.000	CAD	689.880	666.801	0,37
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	650.000	EUR	646.594	617.208	0,34
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	600.000	USD	534.483	558.535	0,31
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	200.000	EUR	199.388	188.130	0,10
US89114QCA40	Tor Dom Bk 2.65% 19-12.06.24	1.000.000	USD	898.113	932.686	0,51
				<b>8.068.630</b>	<b>8.098.037</b>	<b>4,45</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS1964701822	Aroundtown 5.375% 19-21.03.29	900.000	USD	789.893	915.970	0,50
XS0219724878	Bei 4% 05-15.10.37	1.000.000	EUR	1.163.854	1.642.070	0,90
US298785DV50	Bei 4.875% 06-15.02.36	2.200.000	USD	1.856.886	2.999.699	1,66
XS2050404800	Dh Eur 0.45% 19-18.03.28	250.000	EUR	249.378	224.195	0,12
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	200.000	EUR	198.254	183.632	0,10
				<b>4.258.265</b>	<b>5.965.566</b>	<b>3,28</b>
<b>Mexique</b>						
US191241AH15	Coca Co F 2.75% 20-22.01.30	150.000	USD	133.511	133.388	0,07
				<b>133.511</b>	<b>133.388</b>	<b>0,07</b>
<b>Pays-Bas</b>						
DE000A28RSR6	Allianz Fin 0.50% 20-14.01.31 Regs	400.000	EUR	397.064	366.564	0,20
XS0092607497	Bng 5.375% 98-7.6.21 Emtn	830.000	GBP	1.283.583	991.668	0,55
XS0177089298	Enel Inv 5.25% 03-29.09.23	500.000	EUR	563.665	575.895	0,32
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	400.000	EUR	400.000	404.000	0,22
XS1771838494	Ing Groep 1.125% 18-14.02.25	500.000	EUR	496.150	480.575	0,26
XS1882544973	Ing Groep 2% 18-20.09.28	1.000.000	EUR	1.139.500	983.120	0,54
XS2056374353	Mondelez In 0.875% 19-1.10.31	400.000	EUR	394.196	373.596	0,21
XS0228265574	Rabobk 4.55% 05-30.8.29 1434a	700.000	GBP	925.603	933.004	0,51

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS2049616621	Siemens Fin 0.125% 19-5.9.29	300.000	EUR	298.395	272.376	0,15
				<b>5.898.156</b>	<b>5.380.798</b>	<b>2,96</b>
	<b>Philippines</b>					
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	180.000.000	JPY	1.600.490	1.808.728	0,99
				<b>1.600.490</b>	<b>1.808.728</b>	<b>0,99</b>
	<b>Pologne</b>					
XS1958534528	Poland 1% 19-07.03.29 Regs	1.250.000	EUR	1.243.275	1.326.600	0,73
				<b>1.243.275</b>	<b>1.326.600</b>	<b>0,73</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	100.000	EUR	100.000	103.480	0,06
				<b>100.000</b>	<b>103.480</b>	<b>0,06</b>
	<b>Roumanie</b>					
XS2027596530	Romania 2.124% 19-16.7.31 Regs	1.000.000	EUR	1.031.800	918.860	0,51
				<b>1.031.800</b>	<b>918.860</b>	<b>0,51</b>
	<b>Suède</b>					
XS1842961440	Nordea 0.875% 18-26.06.23	1.000.000	EUR	1.001.250	970.050	0,53
				<b>1.001.250</b>	<b>970.050</b>	<b>0,53</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0314209351	Ubs Grp Fdg 2.125% 16-04.03.24	1.000.000	EUR	1.058.270	1.004.050	0,55
				<b>1.058.270</b>	<b>1.004.050</b>	<b>0,55</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	400.000	EUR	399.012	387.288	0,21
XS2013745703	Bbva 1% 19-21.06.26	1.000.000	EUR	1.029.985	925.280	0,51
XS2076079594	Bco Sab 0.625% 19-07.11.25	500.000	EUR	495.625	463.635	0,26
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	400.000	EUR	398.344	381.268	0,21
XS1201001572	Santander I 2.5% 15-18.03.25	500.000	EUR	548.815	484.530	0,27
CH0505011947	Santander 0.20% 19-19.11.27	500.000	CHF	453.624	420.927	0,23
ES00000128Q6	Spain 2.35% 17-30.07.33 Regs	2.000.000	EUR	2.463.400	2.365.400	1,30
				<b>5.788.805</b>	<b>5.428.328</b>	<b>2,99</b>
	<b>Corée du Sud</b>					
XS1999730374	Kr Hous Fin 0.10% 19-18.06.24	325.000	EUR	324.886	326.355	0,18
				<b>324.886</b>	<b>326.355</b>	<b>0,18</b>
	<b>Venezuela</b>					
XS1943474483	Corp Andina 0.625% 19-30.01.24	1.000.000	EUR	998.400	1.002.380	0,55
				<b>998.400</b>	<b>1.002.380</b>	<b>0,55</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	600.000	USD	535.915	602.597	0,33
XS0252367775	Amer Intl Grp 5% 06-26.4.23	300.000	GBP	376.183	367.022	0,20



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US031162BV19	Amgen 3.625% 14-22.05.24	1.000.000	USD	950.888	960.465	0,53
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	400.000	EUR	396.992	374.012	0,21
US037833DN70	Apple Inc 2.05% 19-11.09.26	400.000	USD	361.539	374.711	0,21
US037833CG39	Apple Inc 3% 17-09.02.24	1.000.000	USD	934.919	965.295	0,53
US06051GFF19	Boa 4% 14-01.04.24	1.000.000	USD	957.620	974.053	0,54
XS1901137361	Celanese Us 2.125% 18-01.03.27	1.000.000	EUR	978.090	984.690	0,54
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	250.000	USD	223.907	215.865	0,12
US36962GXZ26	Gecc 6.75% 02-15.3.32 Mtn	300.000	USD	289.217	329.280	0,18
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	300.000	EUR	299.877	286.758	0,16
XS2043678841	Gldm Sachs 0.125% 19-19.8.24 Regs	500.000	EUR	497.445	462.175	0,25
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	200.000	USD	179.926	162.439	0,09
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	400.000	USD	343.781	534.263	0,29
US459056LD78	Ibrd 7.625% 93-19.01.23	1.000.000	USD	1.097.199	1.089.387	0,60
US58013MEH34	Mc Donald S 5.7% 09-1.2.39	700.000	USD	580.978	800.325	0,44
US58013MFM10	Mcdonalds 2.125% 20-01.03.30	200.000	USD	178.826	169.493	0,09
XS1197270819	Mondelez 1.625% 15-08.03.27	400.000	EUR	405.020	405.860	0,22
US61747YDU64	Mor St 4.1%13-22.5.23	800.000	USD	763.671	751.639	0,41
US66989HAD08	Novartis Cap 4.4% 10-24.04.20	600.000	USD	489.629	548.342	0,30
CH0471297959	Ny Life Gbl 0.25% 19-18.10.27 Regs	300.000	CHF	266.969	270.853	0,15
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	600.000	EUR	598.480	503.724	0,28
XS2068969067	Rabobk Ny 0.25% 19-30.10.26	1.000.000	EUR	994.630	910.880	0,50
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	150.000	USD	134.493	143.400	0,08
US9128283R96	Usa 0.5% 18-15.01.28 /infl	3.500.000	USD	2.777.867	3.490.228	1,93
XS1030900242	Verizon Com 3.25% 14-17.02.26	1.000.000	EUR	1.148.370	1.100.870	0,61
				<b>16.762.431</b>	<b>17.778.626</b>	<b>9,79</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>89.578.292</b>	<b>92.724.791</b>	<b>51,00</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	1.951	EUR	216.964	100.184	0,06
FR0010040865	Gecina /act.nom.	616	EUR	93.311	74.351	0,04
FR0000121964	Klepierre	2.261	EUR	73.308	39.726	0,02
				<b>383.583</b>	<b>214.261</b>	<b>0,12</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	2.755	GBP	18.050	17.335	0,01
				<b>18.050</b>	<b>17.335</b>	<b>0,01</b>
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	14.127	CAD	76.974	80.776	0,04
				<b>76.974</b>	<b>80.776</b>	<b>0,04</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	1.175	USD	27.176	25.486	0,01
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	4.052	USD	81.116	61.450	0,04

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US92936U1097	Wp Carey Inc Reit	254	USD	13.459	13.445	0,01
				<b>121.751</b>	<b>100.381</b>	<b>0,06</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>600.358</b>	<b>412.753</b>	<b>0,23</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>124.995.750</b>	<b>124.030.587</b>	<b>68,22</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
CA68333ZAE75	Ontario 2.7% 18-02.06.29	1.000.000	CAD	710.879	686.323	0,38
CA89117FFK09	Tor Dom Bk 3.005% 18-30.05.23	1.000.000	CAD	667.483	656.262	0,36
				<b>1.378.362</b>	<b>1.342.585</b>	<b>0,74</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>1.378.362</b>	<b>1.342.585</b>	<b>0,74</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>1.378.362</b>	<b>1.342.585</b>	<b>0,74</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00B6TLWG59	Gam Star Cat Bd Inst Cl Eur	474.435	EUR	6.111.747	6.375.457	3,50
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	287.911	USD	1.740.262	1.743.603	0,96
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	124.231	USD	5.555.050	5.373.437	2,96
				<b>13.407.059</b>	<b>13.492.497</b>	<b>7,42</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	44.690	USD	4.697.662	4.573.063	2,52
LU1637934156	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Eur	102.491	EUR	9.932.388	9.802.225	5,39
				<b>14.630.050</b>	<b>14.375.288</b>	<b>7,91</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>28.037.109</b>	<b>27.867.785</b>	<b>15,33</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>28.037.109</b>	<b>27.867.785</b>	<b>15,33</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>154.411.221</b>	<b>153.240.957</b>	<b>84,29</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

Répartition géographique	%	Répartition économique	%
Etats-Unis d'Amérique	12,47	Obligations d'Etats et de villes étrangers	16,41
Luxembourg	11,20	Banques et autres institutions financières	15,82
Irlande	8,97	Fonds d'investissements	15,37
France	7,00	Holdings et sociétés financières	7,35
Royaume-Uni	6,98	Supranational	6,03
Canada	5,98	Pharmacie et cosmétique	2,89
Allemagne	5,61	Electrotechnique, électronique	2,11
Pays-Bas	4,42	Alimentation, boissons	1,76
Italie	4,32	Circulation et transport	1,49
Espagne	3,80	Transmission de nouvelles	1,49
Japon	2,74	Assurances	1,46
Belgique	2,65	Articles de bureau et ordinateurs	1,22
Suisse	2,37	Commerce de détail et grands magasins	1,19
Philippines	0,99	Chimie	1,11
Pologne	0,73	Sociétés immobilières	1,06
Côte d'Ivoire	0,72	Internet Software	0,95
Australie	0,56	Energie et service des eaux	0,95
Venezuela	0,55	Pétrole	0,83
Suède	0,53	Construction, matériel de construction	0,75
Roumanie	0,51	Biotechnologie	0,61
Chine	0,32	Gastronomie	0,56
Finlande	0,30	Arts graphiques et maisons d'édition	0,49
Corée du Sud	0,18	Biens de consommation divers	0,40
Portugal	0,13	Mécanique, outillage	0,36
Chili	0,09	Textile et habillement	0,35
Mexique	0,07	Véhicules routiers	0,33
Autriche	0,04	Services divers	0,22
Bermudes	0,03	Santé, éducation et services sociaux	0,19
Jersey	0,02	Caoutchouc et pneus	0,17
Liechtenstein	0,01	Papier et bois	0,12
	<b>84,29</b>	Métaux non ferreux	0,09
		Industrie aéronautique et spatiale	0,06
		Maisons de commerce diverses	0,03
		Mines, aciéries	0,03
		Service d'environnement et de recyclage	0,02
		Industrie horlogère	0,01
		Métaux et pierres précieuses	0,01
			<b>84,29</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Bermudes</b>						
BMG0450A1053	Arch Capital Gp Ltd Bermuda	241	USD	11.546	6.859	0,04
BMG0750C1082	Axalta Coating Systems Ltd	295	USD	8.748	5.095	0,03
BMG169621056	Bunge Ltd	39	USD	1.429	1.600	0,01
BMG3223R1088	Everest Reinsurance Group Ltd	32	USD	9.215	6.157	0,04
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	134	USD	10.780	8.040	0,04
BMG7496G1033	Renaissancere Hld Ltd	32	USD	6.298	4.778	0,03
				<b>48.016</b>	<b>32.529</b>	<b>0,19</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	309	USD	10.455	4.168	0,02
				<b>10.455</b>	<b>4.168</b>	<b>0,02</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB0006731235	Associated British Foods Plc	352	GBP	11.974	7.917	0,05
GB0009895292	Astrazeneca Plc	18	GBP	1.472	1.611	0,01
GB0031348658	Barclays Plc	4.550	GBP	5.689	5.309	0,03
GB0007980591	Bp Plc	2.549	GBP	10.226	10.879	0,05
GB0031743007	Burberry Group Plc	134	GBP	2.145	2.201	0,01
GB00B033F229	Centrica Plc	9.851	GBP	11.753	4.651	0,03
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	634	GBP	13.544	11.908	0,06
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	384	GBP	2.314	2.163	0,01
GB00B0SWJX34	Lse Group	20	GBP	1.742	1.805	0,01
GB0031274896	Marks And Spencer /new	1.256	GBP	3.008	1.546	0,01
GB00B2B0DG97	Relx Plc	219	GBP	4.446	4.703	0,03
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	137	GBP	6.186	6.317	0,04
GB00BKKMKR23	Rsa Insurance Group Plc	546	GBP	2.739	2.846	0,02
GB00B8C3BL03	Sage Grp	216	GBP	1.500	1.585	0,01
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	371	GBP	9.505	6.599	0,04
GB0004082847	Standard Chartered Plc	821	GBP	4.594	4.538	0,03
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	3.899	GBP	6.953	5.681	0,03
GB00B10RZP78	Unilever Plc	182	GBP	10.753	9.197	0,05
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	5.675	GBP	11.387	7.951	0,05
				<b>121.930</b>	<b>99.407</b>	<b>0,57</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	73	USD	13.475	11.918	0,07
IE00BY9D5467	Allergan Plc	23	USD	3.888	4.073	0,02
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	112	USD	11.773	8.701	0,05
IE00B4Q5ZN47	Jazz Pharmaceuticals Plc	12	USD	1.626	1.197	0,01
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	174	USD	6.854	4.691	0,03
IE00BZ12WP82	Linde Plc	14	USD	2.315	2.422	0,01
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	149	USD	15.245	13.438	0,08

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IE00BLS09M33	Pentair Plc	74	USD	2.147	2.202	0,01
				<b>57.323</b>	<b>48.642</b>	<b>0,28</b>
<b>Jersey</b>						
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	68	GBP	5.955	4.263	0,02
				<b>5.955</b>	<b>4.263</b>	<b>0,02</b>
<b>Canada</b>						
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	267	CAD	10.216	2.954	0,02
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	89	CAD	2.093	2.073	0,01
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	269	CAD	11.060	7.365	0,04
CA05534B7604	Bce Inc	177	CAD	8.566	7.179	0,04
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	708	CAD	21.202	9.576	0,07
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	300	CAD	9.094	7.090	0,04
CA15135U1093	Cenovus Energy	994	CAD	9.184	1.983	0,01
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	95	CAD	5.296	5.085	0,03
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	314	CAD	6.921	6.073	0,04
CA9611485090	George Weston Ltd	59	CAD	3.907	4.171	0,02
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	80	CAD	2.183	2.487	0,01
CA45823T1066	Intact Fin	82	CAD	6.816	7.007	0,04
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	65	CAD	2.112	1.893	0,01
CA5592224011	Magna International Inc	61	CAD	1.854	1.925	0,01
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	760	CAD	14.404	9.435	0,05
CA67077M1086	Nutrien Ltd	66	CAD	2.009	2.231	0,01
CA6837151068	Open Text Corp	105	CAD	3.395	3.630	0,02
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	369	CAD	13.476	6.432	0,04
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	89	CAD	3.879	3.546	0,02
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	41	CAD	2.435	2.511	0,01
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	265	CAD	13.149	8.428	0,05
CA8672241079	Suncor Energy	236	CAD	3.146	3.724	0,02
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	31	CAD	1.289	1.303	0,01
CA94106B1013	Waste Connections Inc	85	USD	8.720	6.588	0,04
				<b>166.406</b>	<b>114.689</b>	<b>0,66</b>
<b>Suisse</b>						
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	19	CHF	36.506	38.096	0,22
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	3.604	CHF	48.538	29.799	0,17
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	27	CHF	26.275	18.669	0,11
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	22	CHF	32.724	26.626	0,15
CH0114405324	Garmin	87	USD	8.685	6.522	0,04
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	1.064	CHF	51.921	38.885	0,22
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	533	CHF	44.053	43.987	0,25
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	230	CHF	59.561	74.653	0,44
CH0126881561	Swiss Re-namen	508	CHF	48.377	39.147	0,23
CH0008742519	Swisscom /nam.	69	CHF	32.902	37.098	0,21
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	121	CHF	40.221	42.945	0,25
				<b>429.763</b>	<b>396.427</b>	<b>2,29</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	63	USD	4.458	4.971	0,03
US00287Y1091	Abbvie Inc	151	USD	12.662	11.505	0,07
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	65	USD	3.437	3.866	0,02
US00724F1012	Adobe Inc	15	USD	4.589	4.774	0,03
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc	62	USD	2.767	2.820	0,02
US00130H1059	Aes Corp.	353	USD	6.680	4.801	0,03
US0010551028	Aflac Inc.	126	USD	4.629	4.314	0,02
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	43	USD	3.974	3.934	0,02
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	17	USD	18.730	19.753	0,11
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	23	USD	29.983	26.745	0,15
US0231351067	Amazon Com Inc	26	USD	49.656	50.693	0,29
US0258161092	American Express Co.	88	USD	8.952	7.534	0,04
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	25	USD	3.919	2.562	0,01
US0311621009	Amgen Inc	50	USD	10.495	10.137	0,06
US0367521038	Anthem Inc	8	USD	1.731	1.816	0,01
US0378331005	Apple Inc	285	USD	76.070	72.474	0,42
US0382221051	Applied Materials Inc	151	USD	9.455	6.919	0,04
US0394831020	Archer-daniels Midland Co	69	USD	2.257	2.427	0,01
US03965L1008	Arconic Inc	258	USD	6.346	4.143	0,02
US04621X1081	Assurant Inc	58	USD	7.621	6.037	0,03
US00206R1023	At & T	621	USD	21.646	18.102	0,10
US0605051046	Bank Of America Corp	523	USD	12.281	11.103	0,06
US0865161014	Best Buy Co Inc.	41	USD	3.199	2.337	0,01
US09062X1037	Biogen Inc	13	USD	3.705	4.113	0,02
US09247X1019	Blackrock Inc	19	USD	10.167	8.359	0,05
US09857L1089	Booking Holdings Inc	1	USD	1.366	1.345	0,01
US1011371077	Boston Scientific Corp.	146	USD	4.369	4.764	0,03
US11133T1034	Brdrdg Fncl Solutions /wh.iss.	13	USD	1.221	1.233	0,01
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	220	USD	12.975	12.263	0,07
US1273871087	Cadence Design Systems	26	USD	1.595	1.717	0,01
US1344291091	Campbell Soup Co.	69	USD	3.295	3.185	0,02
US1491231015	Caterpillar Inc.	22	USD	2.303	2.553	0,01
US12508E1010	Cdk Global Inc	52	USD	1.777	1.708	0,01
US1567001060	Centurylink Inc	114	USD	1.032	1.078	0,01
US1567821046	Cerner Corp	111	USD	7.852	6.992	0,04
US1667641005	Chevron Corporation	145	USD	10.046	10.507	0,06
US1255231003	Cigna Corporation	14	USD	2.196	2.481	0,01
US1729081059	Cintas	34	USD	9.198	5.889	0,03
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	265	USD	9.984	10.417	0,06
US1729674242	Citigroup Inc	254	USD	16.932	10.698	0,06
US1890541097	Clorox Co *opa*	19	USD	3.148	3.292	0,02
US1912161007	Coca-cola Co.	375	USD	22.398	16.594	0,10
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	77	USD	4.612	5.110	0,03
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	371	USD	17.076	12.755	0,07
US20825C1045	Conocophillips	242	USD	14.613	7.454	0,04
US22160K1051	Costco Wholesale Corp	19	USD	5.337	5.417	0,03
US2283681060	Crown Holdings Inc	47	USD	2.541	2.728	0,02
US1264081035	Csx Corp.	21	USD	1.187	1.203	0,01

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US2310211063	Cummins Inc	58	USD	9.694	7.849	0,05
US1266501006	Cvs Health Corp	77	USD	5.666	4.568	0,03
US2521311074	Dexcom Inc	6	USD	1.436	1.616	0,01
US25470F3029	Discovery Com Inc / -c-	82	USD	1.543	1.438	0,01
US25746U1097	Dominion Energy Inc	102	USD	9.015	7.363	0,04
US2600031080	Dover Corp.	27	USD	2.176	2.266	0,01
US2605571031	Dow Inc	35	USD	1.063	1.023	0,01
US26441C2044	Duke Energy	97	USD	7.248	7.845	0,05
US2774321002	Eastman Chemical Co	93	USD	4.333	4.332	0,03
US2786421030	Ebay Inc	55	USD	1.561	1.653	0,01
US2788651006	Ecolab Inc.	18	USD	2.732	2.805	0,02
US28176E1082	Edwards Lifesciences	14	USD	2.673	2.641	0,02
US2855121099	Electronic Arts	36	USD	3.945	3.606	0,02
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	412	USD	9.880	5.953	0,03
US30231G1022	Exxon Mobil Corp	132	USD	7.469	5.012	0,03
US30303M1027	Facebook Inc -a-	160	USD	30.004	26.688	0,15
US3167731005	Fifth Third Bancorp	419	USD	6.211	6.222	0,04
US34354P1057	Flowserve Corp	72	USD	1.656	1.720	0,01
US35137L1052	Fox --- Registered Shs -a-	60	USD	1.449	1.418	0,01
US3156161024	F5 Networks Inc.	47	USD	6.242	5.012	0,03
US3696041033	General Electric Co	584	USD	4.416	4.637	0,03
US3703341046	General Mills Inc	101	USD	5.468	5.330	0,03
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	74	USD	5.156	5.532	0,03
US37959E1029	Globe Life Inc	93	USD	9.426	6.693	0,04
US3802371076	Godaddy Inc	25	USD	1.437	1.428	0,01
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	56	USD	13.035	8.657	0,05
US42824C1099	Hewlett Packard Ent Co	153	USD	1.437	1.486	0,01
US4361061082	Hollyfrontier Corp	111	USD	5.436	2.721	0,02
US4364401012	Hologic Inc	133	USD	7.010	4.668	0,03
US4370761029	Home Depot Inc.	60	USD	13.606	11.203	0,06
US40434L1052	Hp Inc	82	USD	1.261	1.424	0,01
US4448591028	Humana Inc.	7	USD	1.883	2.198	0,01
US4592001014	Ibm Corp	83	USD	8.787	9.207	0,05
US4581401001	Intel Corp.	291	USD	16.679	15.749	0,09
US45866F1049	Intercont Exch	41	USD	3.056	3.311	0,02
US4612021034	Intuit	30	USD	6.978	6.900	0,04
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	8	USD	3.683	3.962	0,02
US47233W1099	Jefferies Financial Group Inc	276	USD	6.548	3.773	0,02
US4781601046	Johnson & Johnson	201	USD	28.289	26.357	0,15
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	16	USD	1.460	1.616	0,01
US48203R1041	Juniper Networks Inc.	105	USD	2.039	2.010	0,01
US4851703029	Kansas City Southern	13	USD	1.759	1.653	0,01
US4878361082	Kellogg Co	31	USD	2.193	1.860	0,01
US4943681035	Kimberly Clark Corp	65	USD	9.105	8.312	0,05
US5010441013	Kroger Co.	92	USD	2.571	2.771	0,02
US5128071082	Lam Research Corp	30	USD	8.085	7.200	0,04
US5312296073	Liberty Media Corp	65	USD	2.852	2.055	0,01
US5324571083	Lilly (eli) & Co	80	USD	11.362	11.098	0,06
US5018892084	Lkq	130	USD	2.600	2.666	0,02
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	85	USD	10.142	7.314	0,04



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US5500211090	Lululemon Athletica Inc	15	USD	3.956	2.843	0,02
US56585A1025	Marathon Petroleum Corp	48	USD	3.056	1.134	0,01
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	78	USD	20.566	18.842	0,11
US5801351017	Mcdonald S Corp.	9	USD	1.467	1.488	0,01
US58155Q1031	Mckesson Corp	16	USD	2.274	2.164	0,01
US58933Y1055	Merck	213	USD	14.409	16.388	0,09
US59156R1086	Metlife Inc	261	USD	12.555	7.979	0,05
US5951121038	Micron Technology Inc	60	USD	2.550	2.524	0,01
US5949181045	Microsoft Corp.	466	USD	65.055	73.494	0,43
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	150	USD	6.918	7.512	0,04
US61174X1090	Monster Beverage Corp	116	USD	8.168	6.526	0,04
US6153691059	Moody S Corp	41	USD	9.697	8.672	0,05
US6174464486	Morgan Stanley	93	USD	3.162	3.162	0,02
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	27	USD	3.609	3.589	0,02
US55354G1004	Msci Inc -a-	4	USD	1.055	1.156	0,01
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	147	USD	7.072	6.656	0,04
US6541061031	Nike Inc B	133	USD	10.510	11.004	0,06
US65473P1057	Nisource Inc	198	USD	4.521	4.944	0,03
US6687711084	Nortonlifelock Rg	171	USD	3.556	3.199	0,02
US6293775085	Nrg Energy Inc	103	USD	3.997	2.808	0,02
US67066G1040	Nvidia Corp.	42	USD	10.318	11.071	0,06
US6907421019	Owens Corning Inc	104	USD	6.587	4.036	0,02
US6974351057	Palo Alto Networks Inc	7	USD	1.162	1.148	0,01
US7010941042	Parker-hannifin	49	USD	6.201	6.357	0,04
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	65	USD	6.222	6.223	0,04
US7134481081	Pepsico Inc	130	USD	17.685	15.613	0,09
US7170811035	Pfizer Inc.	296	USD	8.807	9.661	0,06
US7185461040	Phillips 66	25	USD	1.263	1.341	0,01
US6934751057	Pnc Financial Services Gp	27	USD	2.486	2.584	0,01
US6935061076	Ppg Industries Inc.	84	USD	10.093	7.022	0,04
US69351T1060	Ppl Corp	281	USD	6.248	6.935	0,04
US7458671010	Pultegroup Inc	283	USD	11.035	6.317	0,04
US74736K1016	Qorvo Inc	31	USD	3.391	2.500	0,01
US7475251036	Qualcomm Inc.	122	USD	10.840	8.253	0,05
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	46	USD	4.724	3.694	0,02
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	7	USD	3.009	3.418	0,02
US7591EP1005	Regions Financial Corp	759	USD	12.457	6.808	0,04
US7607591002	Republic Services Inc.	89	USD	7.414	6.680	0,04
US7782961038	Ross Stores Inc	19	USD	1.545	1.652	0,01
US79466L3024	Salesforce Com Inc	42	USD	6.177	6.047	0,03
US7841171033	Sei Investments Co	102	USD	6.484	4.727	0,03
US8243481061	Sherwin-williams Co	10	USD	5.842	4.595	0,03
US82968B1035	Sirius Xm Holdings Inc	1.095	USD	7.122	5.409	0,03
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc	24	USD	2.715	2.145	0,01
US8330341012	Snap-on Inc	57	USD	8.980	6.203	0,04
US78409V1044	S&p Global Shs	41	USD	9.406	10.047	0,06
US8545021011	Stanley Black & Decker Inc	26	USD	2.555	2.600	0,02
US87165B1035	Synchrony Financial	168	USD	2.799	2.703	0,02
US8716071076	Synopsys Inc.	37	USD	4.490	4.765	0,03
US8718291078	Sysco Corp.	98	USD	7.364	4.472	0,03



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US74144T1088	T Rowe Price Group Inc.	42	USD	5.546	4.101	0,02
US87612E1064	Target Corp	66	USD	6.555	6.136	0,04
US4278661081	The Hershey Co	10	USD	1.262	1.325	0,01
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc	4	USD	1.087	1.134	0,01
US8725401090	Tjx Companies Inc	189	USD	10.408	9.036	0,05
US89400J1079	Transunion	40	USD	2.631	2.647	0,02
US9078181081	Union Pacific Corp.	55	USD	7.311	7.757	0,04
US9113631090	United Rentals Inc.	21	USD	2.943	2.161	0,01
US9130171096	United Technologies Corp	116	USD	17.391	10.942	0,06
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	58	USD	14.721	14.464	0,08
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc	41	USD	5.126	4.209	0,02
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	17	USD	3.572	4.045	0,02
US92826C8394	Visa Inc -a	138	USD	25.486	22.235	0,13
US9285634021	Vmware Inc	17	USD	1.976	2.059	0,01
US9290891004	Voya Financial	56	USD	2.136	2.271	0,01
US9297401088	Wabtec Corp	41	USD	1.915	1.973	0,01
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc	26	USD	1.078	1.190	0,01
US2546871060	Walt Disney	67	USD	7.260	6.472	0,04
US96145D1054	Westrock Co	79	USD	3.432	2.233	0,01
US9633201069	Whirlpool Corp.	31	USD	4.635	2.660	0,02
US3848021040	Ww Grainger Inc	6	USD	1.989	1.491	0,01
US9884981013	Yum Brands Shs	60	USD	4.373	4.112	0,02
US88579Y1010	3m Co	16	USD	2.105	2.184	0,01
				<b>1.308.729</b>	<b>1.170.390</b>	<b>6,77</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>2.148.577</b>	<b>1.870.515</b>	<b>10,80</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
US2027A1JT52	Cw Bk Austr 3.15% 17-19.09.27	200.000	USD	203.382	207.350	1,19
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	100.000	USD	99.956	99.768	0,58
				<b>303.338</b>	<b>307.118</b>	<b>1,77</b>
<b>Belgique</b>						
BE0000320292	Belgium 4.25% 10-28.3.41 Olo	100.000	EUR	193.054	187.987	1,09
				<b>193.054</b>	<b>187.987</b>	<b>1,09</b>
<b>Brésil</b>						
US105756CA66	Brazil 4.5% 19-30.05.29	200.000	USD	212.000	206.294	1,19
				<b>212.000</b>	<b>206.294</b>	<b>1,19</b>
<b>Caïmans (Iles)</b>						
US88032XAD66	Tencent Hol 3.8% 15-11.02.25	200.000	USD	196.222	213.900	1,24
				<b>196.222</b>	<b>213.900</b>	<b>1,24</b>
<b>Chili</b>						
US05968AAG13	Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	200.000	USD	200.000	187.616	1,08
				<b>200.000</b>	<b>187.616</b>	<b>1,08</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Allemagne</b>						
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	100.000	USD	99.900	106.621	0,62
US500769HS68	Kfw 2.875% 18-03.04.28	200.000	USD	197.729	230.834	1,33
US515110BN30	Lwf Rentbk 2% 15-13.01.25	200.000	USD	188.207	212.856	1,23
				<b>485.836</b>	<b>550.311</b>	<b>3,18</b>
<b>France</b>						
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	100.000	EUR	144.591	146.666	0,85
				<b>144.591</b>	<b>146.666</b>	<b>0,85</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS1550975079	Barclays 3.125% 17-17.01.24	100.000	GBP	133.096	121.175	0,70
XS1823595647	Hsbc Hldg 2.175% 18-27.06.23	200.000	GBP	264.493	243.668	1,40
US53944VAH24	Lloyds 3.5% 15-14.05.25	200.000	USD	196.268	195.080	1,13
				<b>593.857</b>	<b>559.923</b>	<b>3,23</b>
<b>Irlande</b>						
XS1288894691	Swisscom Ag 1.75% 15-15.09.25	100.000	EUR	124.999	115.271	0,67
				<b>124.999</b>	<b>115.271</b>	<b>0,67</b>
<b>Japon</b>						
US606822AU87	Mit Ufj Fin 3.777% 18-02.03.25	100.000	USD	101.263	104.965	0,61
				<b>101.263</b>	<b>104.965</b>	<b>0,61</b>
<b>Jersey</b>						
USG91703AB73	Ubs Grp Fdg 4.125% 15-24.09.25	200.000	USD	199.866	209.148	1,21
				<b>199.866</b>	<b>209.148</b>	<b>1,21</b>
<b>Canada</b>						
US63307A2J35	Natl Bk 2.10% 20-01.02.23	250.000	USD	249.918	247.358	1,43
US68323ACT97	Ontario 3.2% 14-16.05.24	200.000	USD	199.672	218.640	1,26
CA683234ZP62	Ontario 4.6% 08-2.6.39	200.000	CAD	199.779	186.114	1,07
US748149AJ05	Quebec 2.5% 16-20.04.26	200.000	USD	190.660	216.716	1,25
US748148QR73	Quebec 7.5% 99-15.09.29	200.000	USD	292.998	308.620	1,78
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	100.000	USD	99.868	102.142	0,59
US89114QCB23	Tor Dom Bk 3.25% 19-11.03.24	300.000	USD	309.059	313.539	1,81
				<b>1.541.954</b>	<b>1.593.129</b>	<b>9,19</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS1964701822	Aroundtown 5.375% 19-21.03.29	200.000	USD	198.430	223.344	1,29
US298785JA59	Eib 1.625% 19-09.10.29	500.000	USD	486.851	528.555	3,05
				<b>685.281</b>	<b>751.899</b>	<b>4,34</b>
<b>Pays-Bas</b>						
US21685WDD65	Rabobk 3.875% 12-08.02.22	200.000	USD	203.036	205.744	1,19
				<b>203.036</b>	<b>205.744</b>	<b>1,19</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Philippines</b>						
US045167EP43	Adb 1.75% 19-19.09.29	100.000	USD	98.624	106.631	0,62
				<b>98.624</b>	<b>106.631</b>	<b>0,62</b>
<b>Roumanie</b>						
XS1892141620	Romania 2.875% 18-11.03.29	100.000	EUR	124.933	114.432	0,66
				<b>124.933</b>	<b>114.432</b>	<b>0,66</b>
<b>Espagne</b>						
US05964HAF29	Santander 3.8% 17-23.02.28	400.000	USD	407.200	393.212	2,27
ES00000127A2	Spanish Gov 1.95% 15-30.07.30	200.000	EUR	256.850	247.079	1,43
US87938WAT09	Telefonica 4.103% 17-08.03.27	100.000	USD	98.000	102.967	0,59
				<b>762.050</b>	<b>743.258</b>	<b>4,29</b>
<b>Corée du Sud</b>						
US50064FAR55	Korea 2% 19-19.06.24	200.000	USD	198.332	207.844	1,20
				<b>198.332</b>	<b>207.844</b>	<b>1,20</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US026874DH71	Aig 3.9% 16-01.04.26	200.000	USD	194.084	208.224	1,20
US031162CP32	Amgen 2.65% 17-11.05.22	100.000	USD	97.148	100.971	0,58
US06051GHD43	Boa 3.419% 17-20.12.28	100.000	USD	94.732	103.248	0,60
CA172967JB81	Citigroup I 3.39% 14-18.11.21	100.000	CAD	77.365	71.152	0,41
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	100.000	USD	99.782	94.743	0,55
US370334CG79	Gen Mills 4.2% 18-17.04.28	200.000	USD	192.908	221.578	1,28
US38141GWB66	Gs 3.85% 17-26.01.27	100.000	USD	106.019	103.510	0,60
US38141GGS75	Gs 5.75% 12-24.01.22	100.000	USD	107.050	106.237	0,61
US459058GE72	Ibrd 2.5% 17-22.11.27	200.000	USD	191.736	223.886	1,29
US46647PAM86	Jpm 3.509% 18-23.01.29	100.000	USD	95.548	104.759	0,60
US58013MEY66	Mcdonalds 3.7% 15-30.01.26	100.000	USD	99.973	105.653	0,61
US58933YAR62	Merck 2.75% 15-10.02.25	100.000	USD	96.147	106.056	0,61
US594918BY93	Micro Corp 3.3% 17-06.02.27	100.000	USD	99.663	110.960	0,64
US609207AM78	Mondelez 4.125% 18-07.05.28	100.000	USD	99.360	108.047	0,62
US61761J3R84	Mor St 3.125% 16-27.07.26	100.000	USD	93.704	103.774	0,60
US6174468G77	Mor St 4.431% 19-23.01.30	200.000	USD	229.987	222.606	1,29
XS1796233150	Nestle 2.125% 18-22.03.23 Regs	200.000	USD	199.739	209.190	1,21
US66989HAG39	Novartis Cap 3.4% 14-06.05.24	100.000	USD	99.041	107.491	0,62
US912828YS30	Usa 1.75% 19-15.11.29 /tbo	300.000	USD	296.227	330.164	1,91
US912810PX00	Usa 4.5% 08-15.05.38 Tbo	500.000	USD	706.828	794.569	4,58
				<b>3.277.041</b>	<b>3.536.818</b>	<b>20,41</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>9.646.277</b>	<b>10.048.954</b>	<b>58,02</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	176	GBP	1.249	1.215	0,01
				<b>1.249</b>	<b>1.215</b>	<b>0,01</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	486	CAD	2.869	3.049	0,02
				<b>2.869</b>	<b>3.049</b>	<b>0,02</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US03027X1000	American Tower Corp	15	USD	2.989	3.266	0,02
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	591	USD	3.517	2.996	0,02
US1011211018	Boston Properties	19	USD	1.727	1.752	0,01
US22822V1017	Crown Castle International Shs	68	USD	9.797	9.820	0,07
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	87	USD	2.180	2.071	0,01
US58463J3041	Medical Properties Trust Inc	413	USD	9.531	7.141	0,04
US6819361006	Omega Healthcare Investors	158	USD	7.040	4.193	0,02
US7561091049	Realty Income Corp	110	USD	8.743	5.485	0,03
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	457	USD	12.191	7.604	0,04
US92936U1097	Wp Carey Inc Reit	44	USD	2.526	2.556	0,01
				<b>60.241</b>	<b>46.884</b>	<b>0,27</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>64.359</b>	<b>51.148</b>	<b>0,30</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>11.859.213</b>	<b>11.970.617</b>	<b>69,12</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
CA06367X7W56	Bmo 2.27% 17-11.07.22	200.000	CAD	151.184	140.695	0,81
CA74814ZEW91	Quebec Prov 3.5% 15-01.12.48	200.000	CAD	187.777	168.122	0,97
				<b>338.961</b>	<b>308.817</b>	<b>1,78</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>338.961</b>	<b>308.817</b>	<b>1,78</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>338.961</b>	<b>308.817</b>	<b>1,78</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00B3ZBQ888	Gam Star Cat Bd -inst- Usd	67.711	USD	736.564	724.555	4,18
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	20.208	USD	137.964	134.282	0,78
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	10.728	USD	536.561	509.151	2,94
				<b>1.411.089</b>	<b>1.367.988</b>	<b>7,90</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	5.576	USD	749.102	626.073	3,61
LU1637934230	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nt	13.253	USD	1.388.996	1.368.770	7,91
LU1900092039	Swisscanto (lu) Equity Fund Systematic Responsible Eurozone Nt	2.132	EUR	244.818	197.019	1,14

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
LU1900092971	Swisscanto (lu) Equity Fund Systematic Responsible Japan Nt Chf	2.211	CHF	220.357	202.853	1,17
				<b>2.603.273</b>	<b>2.394.715</b>	<b>13,83</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>4.014.362</b>	<b>3.762.703</b>	<b>21,73</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>4.014.362</b>	<b>3.762.703</b>	<b>21,73</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>16.212.536</b>	<b>16.042.137</b>	<b>92,63</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Etats-Unis d'Amérique	27,45	Fonds d'investissements	21,75
Luxembourg	18,17	Banques et autres institutions financières	21,56
Canada	11,65	Obligations d'Etats et de villes étrangers	19,24
Irlande	8,85	Holdings et sociétés financières	6,28
Espagne	4,29	Supranational	4,96
Royaume-Uni	3,81	Alimentation, boissons	2,56
Allemagne	3,18	Pharmacie et cosmétique	2,14
Suisse	2,29	Assurances	2,11
Australie	1,77	Sociétés immobilières	1,57
Caïmans (Iles)	1,24	Arts graphiques et maisons d'édition	1,42
Jersey	1,23	Internet Software	1,18
Corée du Sud	1,20	Commerce de détail et grands magasins	1,14
Brésil	1,19	Transmission de nouvelles	1,08
Pays-Bas	1,19	Energie et service des eaux	0,87
Belgique	1,09	Biotechnologie	0,73
Chili	1,08	Gastronomie	0,64
France	0,85	Construction, matériel de construction	0,55
Roumanie	0,66	Articles de bureau et ordinateurs	0,55
Philippines	0,62	Pétrole	0,38
Japon	0,61	Mécanique, outillage	0,37
Bermudes	0,19	Electrotechnique, électronique	0,34
Curacao	0,02	Services divers	0,23
	<b>92,63</b>	Santé, éducation et services sociaux	0,18
		Textile et habillement	0,12
		Biens de consommation divers	0,13
		Chimie	0,09
		Industrie aéronautique et spatiale	0,08
		Service d'environnement et de recyclage	0,08
		Circulation et transport	0,06
		Papier et bois	0,06
		Métaux non ferreux	0,06
		Métaux et pierres précieuses	0,04
		Véhicules routiers	0,03
		Maisons de commerce diverses	0,03
		Agriculture et pêche	0,01
		Mines, aciéries	0,01
			<b>92,63</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0003826436	Telenet Group Holding	3.949	EUR	168.150	115.040	0,02
BE0003739530	Ucb	4.057	EUR	382.907	340.261	0,04
				<b>551.057</b>	<b>455.301</b>	<b>0,06</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG169621056	Bunge Ltd	1.420	USD	50.894	56.372	0,01
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	5.680	USD	448.925	329.741	0,04
				<b>499.819</b>	<b>386.113</b>	<b>0,05</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	3.753	USD	53.613	48.985	0,01
				<b>53.613</b>	<b>48.985</b>	<b>0,01</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	1.844	EUR	561.468	403.085	0,05
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	3.874	EUR	834.313	645.217	0,09
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	656	EUR	66.512	64.462	0,01
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	1.959	EUR	222.141	183.747	0,02
DE0005439004	Continental Ag	834	EUR	59.243	58.092	0,01
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	11.644	EUR	79.393	73.788	0,01
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	3.209	EUR	458.440	425.852	0,06
DE0005552004	Deutsche Post Ag	11.847	EUR	449.320	311.603	0,04
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	15.011	EUR	190.763	188.272	0,03
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-	13.934	EUR	392.896	282.102	0,04
DE0006048432	Henkel / Vorzug	2.665	EUR	202.470	207.104	0,03
DE0006048408	Henkel Ag & Co. Kгаа	2.235	EUR	148.766	159.807	0,02
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	2.200	EUR	498.794	429.987	0,06
DE0007164600	Sap Se	4.354	EUR	456.867	475.183	0,06
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	4.327	EUR	487.970	355.877	0,05
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	105.264	EUR	419.735	252.450	0,03
DE000UNSE018	Uniper Se	7.648	EUR	216.654	182.607	0,02
				<b>5.745.745</b>	<b>4.699.235</b>	<b>0,63</b>
<b>Finlande</b>						
FI0009007132	Fortum Corporation	6.214	EUR	86.675	88.236	0,01
FI0009007835	Metso Corp	12.245	EUR	434.715	282.356	0,04
FI0009000681	Nokia Oy	31.550	EUR	95.103	96.097	0,01
				<b>616.493</b>	<b>466.689</b>	<b>0,06</b>
<b>France</b>						
FR0000120073	Air Liquide	4.665	EUR	590.606	577.718	0,07
FR0000120628	Axa	26.818	EUR	725.010	449.503	0,06
FR0000131104	Bnp Paribas	9.333	EUR	297.652	272.578	0,04

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000120644	Danone.	3.688	EUR	220.027	229.596	0,03
FR0000130452	Eiffage Sa	4.246	EUR	463.491	290.750	0,04
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	3.511	EUR	528.566	366.332	0,05
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	18.728	EUR	357.270	189.401	0,03
FR0000121485	Kering Sa	868	EUR	545.988	438.546	0,06
FR0000120321	L Oreal	1.149	EUR	334.054	291.417	0,04
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	1.968	EUR	120.633	122.183	0,02
FR0000121261	Michelin B /nom.	2.182	EUR	186.407	187.776	0,03
FR0000125007	Saint-gobain	14.859	EUR	611.326	349.653	0,05
FR0000120578	Sanofi	6.134	EUR	504.484	521.882	0,07
FR0000121972	Schneider Electric Se	6.134	EUR	672.013	511.723	0,07
FR0010613471	Suez Environnement Cie	24.527	EUR	355.049	241.537	0,03
FR0000120271	Total Sa	20.522	EUR	1.160.923	771.045	0,09
FR0000124141	Veolia Environnement	15.056	EUR	393.477	311.291	0,04
				<b>8.066.976</b>	<b>6.122.931</b>	<b>0,82</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00B02J6398	Admiral Group Plc	5.249	GBP	137.507	140.430	0,02
GB0000456144	Antofagasta Plc	6.079	GBP	52.035	56.375	0,01
GB0000536739	Ashtead Group Plc	7.999	GBP	235.729	169.426	0,02
GB0006731235	Associated British Foods Plc	13.619	GBP	441.907	296.388	0,04
GB0009895292	Astrazeneca Plc	5.923	GBP	473.841	512.762	0,07
GB0031348658	Barclays Plc	158.139	GBP	193.443	178.547	0,02
GB0007980591	Bp Plc	190.092	GBP	849.458	784.969	0,11
GB0031743007	Burberry Group Plc	20.210	GBP	531.913	321.141	0,04
GB00B033F229	Centrica Plc	349.627	GBP	654.247	159.727	0,02
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	10.405	GBP	134.643	157.785	0,02
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	41.155	GBP	863.624	747.822	0,10
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	68.482	GBP	495.134	373.206	0,05
GB0008706128	Lloyds Banking Group Plc	166.815	GBP	70.854	64.042	0,01
GB00B0SWJX34	Lse Group	727	GBP	61.943	63.496	0,01
GB0031274896	Marks And Spencer /new	92.414	GBP	217.449	110.028	0,01
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	187.320	GBP	438.074	205.628	0,03
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	22.044	GBP	223.493	105.786	0,01
GB0032089863	Next Plc	1.935	GBP	147.762	94.529	0,01
GB0006825383	Persimmon Plc	8.207	GBP	311.259	188.700	0,03
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	3.150	GBP	209.454	232.415	0,03
GB00B2B0DG97	Relx Plc	24.315	GBP	612.696	505.243	0,07
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	12.648	GBP	558.722	564.245	0,08
GB00B8C3BL03	Sage Grp	9.495	GBP	64.519	67.414	0,01
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	7.486	GBP	122.495	128.833	0,02
GB00B1WY2338	Smiths Group Plc	5.181	GBP	67.013	76.205	0,01
GB0004082847	Standard Chartered Plc	36.910	GBP	202.061	197.407	0,03
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	182.743	GBP	333.817	257.606	0,03
GB0008847096	Tesco Plc	57.681	GBP	147.746	158.331	0,02
GB00B10RZP78	Unilever Plc	11.016	GBP	655.816	538.620	0,07
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	326.853	GBP	618.608	443.107	0,06
				<b>10.127.262</b>	<b>7.900.213</b>	<b>1,06</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	2.641	USD	408.418	417.178	0,07
IE00BY9D5467	Allergan Plc	647	USD	106.986	110.865	0,01
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	4.413	USD	337.468	331.721	0,04
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	8.583	USD	340.019	223.889	0,03
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	4.470	USD	424.906	390.024	0,05
IE00BLS09M33	Pentair Plc	2.181	USD	61.907	62.800	0,01
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	11.206	EUR	407.627	305.986	0,04
				<b>2.087.331</b>	<b>1.842.463</b>	<b>0,25</b>
<b>Italie</b>						
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	6.322	EUR	124.912	83.292	0,01
IT0003128367	Enel	68.553	EUR	375.898	461.346	0,06
IT0003132476	Eni Spa Roma	42.727	EUR	741.634	418.228	0,06
NL0011585146	Ferrari N.v.	999	EUR	148.132	150.126	0,02
IT0003796171	Poste Italiane Spa	12.053	EUR	134.041	98.785	0,01
				<b>1.524.617</b>	<b>1.211.777</b>	<b>0,16</b>
<b>Japon</b>						
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	5.100	JPY	127.624	121.769	0,02
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	6.900	JPY	113.264	124.332	0,02
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	29.600	JPY	449.082	443.301	0,06
JP3242800005	Canon Inc.	11.300	JPY	245.963	238.912	0,03
JP3566800003	Central Japan Railway Co	1.900	JPY	302.793	294.939	0,04
JP3511800009	Chiba Bank	61.300	JPY	336.000	259.868	0,03
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	15.300	JPY	389.175	315.529	0,04
JP3485800001	Daicel --- Shs	35.300	JPY	365.469	249.622	0,03
JP3551500006	Denso Corp	12.100	JPY	489.347	378.587	0,05
JP3160400002	Eisai Co.ltd	2.300	JPY	153.341	163.488	0,02
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	13.100	JPY	229.932	227.539	0,03
JP3802400006	Fanuc Corp --- Shs	600	JPY	80.947	78.808	0,01
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	400	JPY	177.154	158.422	0,02
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	9.500	JPY	290.898	208.518	0,03
JP3818000006	Fujitsu Ltd	3.100	JPY	270.275	271.032	0,04
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	7.100	JPY	72.503	69.361	0,01
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	3.100	JPY	183.787	221.715	0,03
JP3788600009	Hitachi Ltd	16.400	JPY	582.907	461.976	0,06
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	14.200	JPY	323.425	309.261	0,04
JP3845770001	Hoshizaki Corp	600	JPY	47.994	43.612	0,01
JP3837800006	Hoya Corp	1.700	JPY	134.027	140.174	0,02
JP3294460005	Inpex Corp	58.500	JPY	554.086	319.199	0,04
JP3143900003	Itochu Techno-solutions	7.500	JPY	197.655	207.371	0,03
JP3705200008	Japan Air Lines Co Jpy50	2.800	JPY	53.178	49.939	0,01
JP3386030005	Jfe Holdings Inc	7.900	JPY	58.683	49.775	0,01
JP3205800000	Kao Corp.	6.200	JPY	506.509	490.663	0,06
JP3496400007	Kddi Corp.	12.300	JPY	350.134	351.663	0,05
JP3266400005	Kubota Corp	5.900	JPY	68.149	73.052	0,01
JP3982100004	Lawson Inc	5.000	JPY	273.624	265.739	0,04
JP3626800001	Lixil Group Shs	26.900	JPY	453.652	324.269	0,04

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	20.500	JPY	305.098	293.052	0,04
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	54.500	JPY	327.329	259.860	0,03
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	5.600	JPY	95.145	93.881	0,01
JP3885780001	Mizuho Financial Groupinc	163.200	JPY	193.164	180.788	0,02
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	12.700	JPY	416.014	344.318	0,05
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	3.300	JPY	159.655	161.842	0,02
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	900	JPY	340.391	335.638	0,05
JP3743000006	Nippon Meat Packers	4.000	JPY	144.683	134.976	0,02
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co.ltd.	3.100	JPY	158.790	157.257	0,02
JP3735400008	Nippon Tel&tel	15.600	JPY	379.604	360.095	0,05
JP3672400003	Nissan Motor Co.ltd	22.700	JPY	79.946	72.550	0,01
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	8.800	JPY	135.682	142.124	0,02
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	7.400	JPY	419.096	320.007	0,04
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	18.400	JPY	417.110	289.418	0,04
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	16.400	JPY	426.492	496.370	0,06
JP3190000004	Obayashi Corp.	37.000	JPY	339.718	307.074	0,04
JP3201200007	Olympus Corp	21.800	JPY	258.887	305.189	0,04
JP3200450009	Orix Corp	18.900	JPY	270.583	220.294	0,03
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	2.500	JPY	86.707	94.801	0,01
JP3866800000	Panasonic Corp	12.800	JPY	94.733	94.644	0,01
JP3855900001	Pola Orbis Holdings Inc	2.800	JPY	50.768	50.065	0,01
JP3970300004	Recruit Holdings Co.ltd.	6.000	JPY	163.685	150.355	0,02
JP3336000009	Santen Pharmaceutical	4.400	JPY	74.224	73.271	0,01
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	11.700	JPY	201.509	150.267	0,02
JP3162770006	Sg Holdings Co. Ltd.	2.100	JPY	44.991	48.427	0,01
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	5.100	JPY	453.618	490.457	0,07
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	2.100	JPY	92.877	100.073	0,01
JP3732000009	Softbank Corp.	3.400	JPY	42.362	41.885	0,01
JP3435000009	Sony Corp	12.300	JPY	811.007	707.845	0,09
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	28.800	JPY	83.196	82.857	0,01
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	7.100	JPY	183.937	166.912	0,02
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	11.300	JPY	398.476	316.388	0,04
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	8.500	JPY	245.985	263.588	0,04
JP3336560002	Suntory B & F	7.700	JPY	276.522	281.912	0,04
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Tokyo	12.100	JPY	332.674	200.626	0,03
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	6.600	JPY	193.846	195.677	0,03
JP3544000007	Teijin Ltd	13.700	JPY	260.031	224.700	0,03
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	9.900	JPY	532.010	439.209	0,06
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	2.300	JPY	488.065	419.595	0,06
JP3629000005	Toppan Printing Co.ltd	9.300	JPY	165.463	138.030	0,02
JP3592200004	Toshiba Corp	6.500	JPY	142.568	138.650	0,02
JP3595200001	Tosoh Corp	26.500	JPY	395.155	292.134	0,04
JP3633400001	Toyota Motor Corp	9.655	JPY	590.456	562.553	0,07
JP3933800009	Z Holdings Corporation	74.200	JPY	299.508	231.427	0,03
				<b>19.453.337</b>	<b>17.343.516</b>	<b>2,33</b>
	<b>Jersey</b>					
GB00B19NLV48	Experian Plc	7.950	GBP	209.940	214.694	0,03

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	5.453	GBP	471.945	330.766	0,04
				<b>681.885</b>	<b>545.460</b>	<b>0,07</b>
<b>Canada</b>						
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Limited	4.402	CAD	177.747	168.110	0,02
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	20.871	CAD	799.745	223.453	0,03
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	5.948	CAD	136.812	134.034	0,02
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	7.531	CAD	280.649	199.501	0,03
CA0641491075	Bank Of Nova Scotia	3.429	CAD	133.988	133.959	0,02
CA05534B7604	Bce Inc	7.990	CAD	327.913	313.552	0,04
CA1125851040	Brookfield Asset Mgmt -a-/ltd	1.212	CAD	50.693	51.394	0,01
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	37.339	CAD	1.144.284	488.602	0,07
CA1363751027	Canadian National Railway	2.590	CAD	187.383	193.719	0,03
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Co	334	CAD	68.253	70.508	0,01
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	3.652	CAD	395.634	210.865	0,03
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	9.625	CAD	301.873	220.099	0,03
CA15135U1093	Genovus Energy	89.913	CAD	869.287	173.581	0,02
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	7.019	CAD	416.496	363.526	0,05
CA1254911003	Ci Financial Corp	26.722	CAD	448.691	253.762	0,03
CA2908761018	Emera Inc	4.501	CAD	155.171	169.810	0,02
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	13.307	CAD	250.527	249.028	0,03
CA29250N1050	Enbridge Inc.	7.821	CAD	216.620	217.869	0,03
CA9611485090	George Weston Ltd	1.173	CAD	75.994	80.239	0,01
CA4488112083	Hydro One Ltd	4.981	CAD	86.352	85.800	0,01
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	10.274	CAD	399.268	308.970	0,04
CA45823T1066	Intact Fin	1.712	CAD	139.227	141.549	0,02
CA4969024047	Kinross Gold Corp	22.000	CAD	100.005	84.495	0,01
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	6.381	CAD	202.868	179.794	0,02
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	5.551	CAD	239.897	273.760	0,04
CA5592224011	Magna International Inc	11.847	CAD	655.262	361.671	0,05
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	42.375	CAD	758.986	508.989	0,06
CA6330671034	National Bank Of Canada	10.697	CAD	579.794	395.497	0,05
CA67077M1086	Nutrien Ltd	4.318	CAD	128.586	141.215	0,02
CA6837151068	Open Text Corp	4.449	CAD	140.716	148.826	0,02
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	22.989	CAD	822.621	387.712	0,05
CA7392391016	Power Corp.canada	22.872	CAD	530.138	352.000	0,05
CA7481932084	Quebecor Inc	12.966	CAD	316.799	274.200	0,04
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	4.437	CAD	189.184	171.045	0,02
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	7.807	CAD	550.499	462.608	0,06
CA82509L1076	Shopify Inc	486	CAD	210.464	194.792	0,03
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	12.073	CAD	478.964	371.525	0,05
CA8672241079	Suncor Energy	5.320	CAD	69.390	81.224	0,01
CA8849037095	Thomson Reuters Corp	981	CAD	57.757	63.938	0,01
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	8.879	CAD	428.388	361.115	0,05
CA94106B1013	Waste Connections Inc	1.020	USD	71.328	76.485	0,01
CA92938W2022	Wsp Global Inc	1.192	CAD	59.644	64.758	0,01
				<b>13.653.897</b>	<b>9.407.579</b>	<b>1,26</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Liechtenstein</b>						
LI0355147575	Liechtenst	7.185	CHF	411.132	387.990	0,05
				<b>411.132</b>	<b>387.990</b>	<b>0,05</b>
<b>Pays-Bas</b>						
NL0012969182	Adyen B.v.	130	EUR	101.356	106.353	0,01
NL0000687663	Aercap Holdings Nv	8.471	USD	520.666	186.790	0,03
NL0010273215	Asml Holding Nv	2.266	EUR	588.185	583.259	0,09
NL0012059018	Exor N.v.	4.131	EUR	203.511	206.126	0,03
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	13.953	EUR	256.346	315.298	0,04
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	33.501	EUR	104.160	77.392	0,01
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	11.856	EUR	489.549	464.644	0,06
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	4.516	EUR	93.122	95.288	0,01
NL0000388619	Unilever Nv.	9.696	EUR	571.336	461.210	0,06
				<b>2.928.231</b>	<b>2.496.360</b>	<b>0,34</b>
<b>Portugal</b>						
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	42.814	EUR	144.864	166.268	0,02
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	6.278	EUR	103.231	69.283	0,01
				<b>248.095</b>	<b>235.551</b>	<b>0,03</b>
<b>Suisse</b>						
CH0012221716	Abb	307.793	CHF	4.684.030	5.234.020	0,70
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	55.247	CHF	3.891.574	2.107.121	0,28
CH0432492467	Alcon Inc.	47.442	CHF	2.163.990	2.340.314	0,31
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	84.430	CHF	1.372.507	460.144	0,06
CH0012410517	Baloise Holding/namen	18.269	CHF	2.727.892	2.318.336	0,31
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	948	CHF	1.738.889	1.839.120	0,25
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	406	CHF	1.669.838	2.541.560	0,34
CH0198251305	Coca-cola Hbc	3.965	GBP	79.681	82.627	0,01
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	509.149	CHF	9.152.255	4.073.192	0,55
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	1.882	CHF	2.372.260	1.259.058	0,17
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	1.313	CHF	1.870.334	1.537.523	0,21
CH0114405324	Garmin	3.902	USD	354.469	283.003	0,04
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	7.864	CHF	2.829.198	3.350.064	0,45
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	996	CHF	2.150.399	2.983.020	0,40
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	829	CHF	746.233	955.008	0,13
CH0023868554	Implenia Ag	12.406	CHF	981.739	424.285	0,06
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	2.141	CHF	1.299.677	1.348.830	0,18
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	80.622	CHF	4.259.822	2.850.794	0,38
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	18.243	CHF	1.364.466	1.214.984	0,16
CH0108503795	Meyer Burger	504.562	CHF	857.644	77.753	0,01
CH0038863350	Nestle / Act Nom	300.269	CHF	14.969.126	29.861.751	4,02
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	300.059	CHF	19.996.030	23.959.710	3,22
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	92.760	CHF	18.858.270	29.131.277	3,91
CH0024638196	Schindler Holding/partic	13.483	CHF	2.843.782	2.863.789	0,38
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	1.046	CHF	1.209.001	982.194	0,13
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	198.066	CHF	2.047.335	2.867.996	0,39
CH0418792922	Sika Ltd	15.728	CHF	2.000.176	2.515.694	0,34

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	15.864	CHF	2.446.629	2.766.682	0,37
CH0002178181	Stadler Rail Ag	14.538	CHF	552.444	649.849	0,09
CH0126881561	Swiss Re-namen	76.902	CHF	6.757.644	5.733.813	0,77
CH0008742519	Swisscom /nam.	8.636	CHF	4.341.694	4.492.447	0,60
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	22.908	CHF	1.728.572	872.337	0,12
CH0244767585	Ubs Group Ag	671.804	CHF	21.400.387	6.077.139	0,82
CH0311864901	Vat Group Ltd	10.260	CHF	1.220.166	1.374.840	0,18
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	2.455	CHF	139.820	116.858	0,02
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	25.676	CHF	6.825.976	8.817.137	1,18
				<b>153.903.949</b>	<b>160.364.269</b>	<b>21,54</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0105046009	Aena Sme Sa	2.145	EUR	413.638	226.630	0,03
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	88.171	EUR	304.983	272.909	0,04
ES0130670112	Endesa Sa	14.260	EUR	369.990	294.757	0,04
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	14.419	EUR	144.885	137.526	0,02
ES0148396007	Inditex	9.603	EUR	239.189	241.213	0,03
ES0173516115	Repsol Sa	43.796	EUR	595.103	387.403	0,05
				<b>2.067.788</b>	<b>1.560.438</b>	<b>0,21</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	5.978	USD	327.724	456.417	0,06
US00287Y1091	Abbvie Inc	5.210	USD	454.893	384.069	0,05
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	1.056	USD	54.627	60.773	0,01
US00724F1012	Adobe Inc	170	USD	50.884	52.345	0,01
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc	1.349	USD	58.908	59.362	0,01
US00130H1059	Aes Corp.	17.122	USD	179.231	225.303	0,03
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	2.005	USD	146.291	177.485	0,02
US0171751003	Alleghany Corp (del)	267	USD	209.795	142.692	0,02
US0200021014	Allstate Corp	1.597	USD	173.307	141.739	0,02
US02005N1000	Ally Financial Inc	7.752	USD	207.840	108.231	0,01
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	461	USD	496.901	518.277	0,07
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	749	USD	694.305	842.683	0,10
US0231351067	Amazon Com Inc	702	USD	908.202	1.324.288	0,17
US0258161092	American Express Co.	3.457	USD	374.775	286.350	0,04
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	1.567	USD	250.658	155.375	0,02
US0311621009	Amgen Inc	1.942	USD	399.449	380.926	0,05
US0378331005	Apple Inc	7.795	USD	1.082.159	1.917.868	0,25
US0382221051	Applied Materials Inc	6.548	USD	399.121	290.294	0,04
US03965L1008	Arconic Inc	10.761	USD	299.273	167.214	0,02
US04621X1081	Assurant Inc	2.214	USD	307.966	222.977	0,03
US00206R1023	At & T	20.354	USD	709.824	574.066	0,08
US0605051046	Bank Of America Corp	7.852	USD	162.106	161.289	0,02
US0718131099	Baxter Intl Inc	1.547	USD	112.130	121.525	0,02
US0865161014	Best Buy Co Inc.	1.965	USD	139.125	108.370	0,01
US09062X1037	Biogen Inc	297	USD	82.815	90.916	0,01
US1011371077	Boston Scientific Corp.	3.476	USD	101.760	109.741	0,01
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	3.720	USD	238.201	200.624	0,03
US1491231015	Caterpillar Inc.	675	USD	69.129	75.785	0,01
US12504L1098	Cbre Group -a-	7.819	USD	381.915	285.287	0,04



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US12508E1010	Cdk Global Inc	1.418	USD	47.395	45.070	0,01
US1567821046	Cerner Corp	4.803	USD	339.529	292.724	0,04
US1667641005	Chevron Corporation	2.359	USD	159.886	165.386	0,02
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	12.959	USD	353.264	492.888	0,07
US1729674242	Citigroup Inc	9.939	USD	632.940	405.046	0,05
US1746101054	Citizens Financial Group Inc	4.959	USD	173.002	90.252	0,01
US1890541097	Clorox Co *opa*	399	USD	64.674	66.884	0,01
US1912161007	Coca-cola Co.	12.835	USD	753.129	549.519	0,07
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	1.831	USD	107.295	117.562	0,02
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	4.052	USD	133.094	134.787	0,02
US20825C1045	Conocophillips	12.877	USD	601.512	383.742	0,05
US2310211063	Cummins Inc	869	USD	108.639	113.777	0,02
US1266501006	Cvs Health Corp	812	USD	42.617	46.613	0,01
US2566771059	Dollar General Corporation	497	USD	60.155	72.617	0,01
US2600031080	Dover Corp.	3.863	USD	354.427	313.738	0,04
US26441C2044	Duke Energy	2.873	USD	210.016	224.828	0,03
US28176E1082	Edwards Lifesciences	264	USD	49.319	48.180	0,01
US2855121099	Electronic Arts	1.705	USD	182.937	165.248	0,02
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	18.229	USD	423.465	254.862	0,03
US30231G1022	Exxon Mobil Corp	1.364	USD	49.767	50.110	0,01
US30303M1027	Facebook Inc -a-	3.992	USD	688.905	644.258	0,08
US34354P1057	Flowserve Corp	2.095	USD	47.146	48.425	0,01
US3156161024	F5 Networks Inc.	2.246	USD	293.027	231.720	0,03
US3696041033	General Electric Co	16.868	USD	124.774	129.586	0,02
US3703341046	General Mills Inc	3.796	USD	201.891	193.815	0,03
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	1.552	USD	105.782	112.262	0,02
US37959E1029	Globe Life Inc	898	USD	59.590	62.532	0,01
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	795	USD	120.670	118.911	0,02
US4361061082	Hollyfrontier Corp	3.478	USD	186.516	82.480	0,01
US4364401012	Hologic Inc	1.684	USD	53.155	57.190	0,01
US4370761029	Home Depot Inc.	1.411	USD	250.936	254.899	0,03
US4592001014	Ibm Corp	2.021	USD	209.312	216.915	0,03
US4581401001	Intel Corp.	6.992	USD	399.569	366.128	0,05
US4612021034	Intuit	711	USD	161.800	158.224	0,02
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	165	USD	74.314	79.058	0,01
US4781601046	Johnson & Johnson	6.507	USD	897.334	825.575	0,10
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	1.011	USD	139.568	98.778	0,01
US4851703029	Kansas City Southern	1.308	USD	187.483	160.953	0,02
US4943681035	Kimberly Clark Corp	2.596	USD	352.520	321.179	0,04
US5010441013	Kroger Co.	1.638	USD	44.779	47.736	0,01
US5128071082	Lam Research Corp	1.226	USD	293.542	284.692	0,04
US5312294094	Liberty Media Corp	4.816	USD	240.671	147.667	0,02
US5324571083	Lilly (eli) & Co	1.220	USD	145.560	163.747	0,02
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	2.782	USD	319.030	231.623	0,03
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	2.568	USD	657.302	600.197	0,08
US58155Q1031	Mckesson Corp	825	USD	111.483	107.968	0,01
US58933Y1055	Merck	7.542	USD	498.569	561.452	0,08
US59156R1086	Metlife Inc	11.360	USD	529.552	336.006	0,05
US5949181045	Microsoft Corp.	13.467	USD	741.593	2.054.960	0,27
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	3.466	USD	156.373	167.945	0,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US61174X1090	Monster Beverage Corp	4.961	USD	343.159	270.049	0,04
US6153691059	Moody S Corp	1.650	USD	407.398	337.651	0,05
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	570	USD	74.544	73.306	0,01
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	2.873	USD	133.639	125.868	0,02
US6541061031	Nike Inc B	2.589	USD	200.148	207.263	0,03
US65473P1057	Nisource Inc	6.612	USD	147.699	159.744	0,02
US67066G1040	Nvidia Corp.	1.061	USD	254.986	270.604	0,04
US6907421019	Owens Corning Inc	6.017	USD	390.405	225.942	0,03
US7010941042	Parker-hannifin	1.245	USD	154.135	156.273	0,02
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	1.246	USD	147.465	115.421	0,02
US7134481081	Pepsico Inc	1.705	USD	206.787	198.126	0,03
US7170811035	Pfizer Inc.	7.692	USD	223.905	242.920	0,03
US7512121010	Polo Ralph Lauren	1.639	USD	172.897	105.980	0,01
US6935061076	Ppg Industries Inc.	1.756	USD	147.263	142.038	0,02
US69351T1060	Ppl Corp	7.505	USD	163.240	179.213	0,02
US7458671010	Pultegroup Inc	17.256	USD	671.231	372.656	0,05
US74736K1016	Qorvo Inc	1.437	USD	133.385	112.106	0,02
US7475251036	Qualcomm Inc.	4.662	USD	403.480	305.150	0,04
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	156	USD	65.601	73.701	0,01
US7591EP1005	Regions Financial Corp	31.250	USD	480.956	271.216	0,04
US7607591002	Republic Services Inc.	3.707	USD	293.571	269.218	0,04
US79466L3024	Salesforce Com Inc	1.048	USD	150.797	145.995	0,02
US8330341012	Snap-on Inc	1.120	USD	176.691	117.923	0,02
US78409V1044	S&p Global Shs	1.541	USD	398.439	365.368	0,05
US87165B1035	Synchrony Financial	12.195	USD	394.502	189.850	0,03
US8716071076	Synopsys Inc.	598	USD	70.986	74.517	0,01
US8718291078	Sysco Corp.	5.070	USD	328.757	223.837	0,03
US87612E1064	Target Corp	2.392	USD	171.999	215.168	0,03
US8725401090	Tjx Companies Inc	7.807	USD	456.716	361.141	0,05
US89400J1079	Transunion	1.118	USD	71.946	71.588	0,01
US9024941034	Tyson Foods Inc.-a-	1.840	USD	138.892	103.026	0,01
US9078181081	Union Pacific Corp.	1.463	USD	190.256	199.646	0,03
US9113631090	United Rentals Inc.	1.513	USD	192.097	150.636	0,02
US9130171096	United Technologies Corp	4.135	USD	389.173	377.397	0,05
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	2.470	USD	398.789	595.981	0,08
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	442	USD	90.858	101.761	0,01
US92826C8394	Visa Inc -a	4.628	USD	770.393	721.467	0,09
US9285634021	Vmware Inc	431	USD	49.003	50.500	0,01
US9297401088	Wabtec Corp	1.184	USD	54.101	55.137	0,01
US2546871060	Walt Disney	1.385	USD	136.504	129.450	0,02
US9633201069	Whirlpool Corp.	1.398	USD	199.124	116.056	0,02
US9884981013	Yum Brands Shs	1.718	USD	122.492	113.914	0,02
US88579Y1010	3m Co	562	USD	72.332	74.229	0,01
				<b>32.453.863</b>	<b>31.312.017</b>	<b>4,21</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>255.075.090</b>	<b>246.786.887</b>	<b>33,14</b>
<b>Obligations</b>						
	<b>Australie</b>					
CH0512502995	Cw Bk Austr 0.113% 19-10.12.29	2.000.000	CHF	2.000.000	1.814.500	0,24

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0346828434	Nat Aus Bk 0.3% 17-31.10.25	2.000.000	CHF	1.952.097	1.900.000	0,26
CH0340912168	Transurban 0.65% 16-02.11.26	2.000.000	CHF	1.910.096	1.844.500	0,25
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	400.000	EUR	454.788	403.391	0,05
CH0458097950	Westpac Bk 0.25% 19-29.01.27	1.000.000	CHF	1.001.190	1.016.750	0,14
CH0417086060	Westpac Bk 0.4% 18-06.06.24	1.500.000	CHF	1.503.675	1.472.250	0,20
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	500.000	USD	486.261	482.653	0,06
				<b>9.308.107</b>	<b>8.934.044</b>	<b>1,20</b>
	<b>Bermudes</b>					
CH0401956898	Cbq Finance 0.697% 18-22.03.21	3.000.000	CHF	2.998.500	2.928.900	0,39
				<b>2.998.500</b>	<b>2.928.900</b>	<b>0,39</b>
	<b>Chili</b>					
CH0496632628	Bc Sant Cl 0.135% 19-29.08.29	2.000.000	CHF	1.998.000	1.580.000	0,21
CH0465767785	Bc Sant Cl 0.384% 19-27.09.24	2.000.000	CHF	2.000.000	1.838.500	0,25
CH0479222066	Bco Dest Cl 0.24% 19-06.06.25	2.500.000	CHF	2.500.000	2.210.000	0,30
CH0506071239	Credito 0.10% 20-18.09.26	1.000.000	CHF	1.000.080	883.000	0,12
CH0505011889	Credito 0.25% 19-29.10.25	1.000.000	CHF	1.000.150	905.000	0,12
				<b>8.498.230</b>	<b>7.416.500</b>	<b>1,00</b>
	<b>Chine</b>					
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	1.200.000	USD	1.213.010	1.238.828	0,17
				<b>1.213.010</b>	<b>1.238.828</b>	<b>0,17</b>
	<b>Allemagne</b>					
CH0358181219	Deut Bk 0.75% 17-21.03.22	2.500.000	CHF	2.536.100	2.438.125	0,33
CH0399198396	Deutsche Bk 0.625% 18-08.02.23	6.150.000	CHF	6.134.076	5.793.300	0,77
CH0479514272	Dt Bahn Fin 0.10% 19-19.06.29	1.040.000	CHF	1.040.520	1.001.260	0,13
CH0143838396	Dt Bahn Fin 1.5% 12-21.2.24 Regs	2.000.000	CHF	2.007.600	2.125.500	0,29
XS2101357072	Fresenius 0.75% 20-15.01.28	1.500.000	EUR	1.616.287	1.499.467	0,20
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	900.000	USD	889.615	928.451	0,12
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	1.600.000	EUR	1.722.058	1.614.754	0,22
CH0471297991	Munhyp 0.25% 19-10.05.30	2.000.000	CHF	2.002.160	2.058.000	0,28
				<b>17.948.416</b>	<b>17.458.857</b>	<b>2,34</b>
	<b>Côte d'Ivoire</b>					
XS0043037505	Afdb 7.375% 93-06.04.23	9.900.000	USD	15.379.878	11.451.776	1,54
				<b>15.379.878</b>	<b>11.451.776</b>	<b>1,54</b>
	<b>France</b>					
CH0379610972	Bfcm 0.6% 17-05.04.27	5.000.000	CHF	5.008.100	4.962.500	0,67
XS1419646317	Bnpp 1.5% 16-25.05.28	3.000.000	EUR	3.615.537	3.239.620	0,44
FR0013459757	C Fr Fi Loc 0.10% 19-13.11.29	500.000	EUR	548.476	524.548	0,07
FR0010039008	France Tel 5.625% 04-23.1.34	2.500.000	GBP	3.473.696	3.986.380	0,54
FR0013398229	Gdf Suez 3.25% 19-perp	100.000	EUR	111.654	105.444	0,01
XS0096412548	Rff 5.25% 99-07.12.28	3.500.000	GBP	8.652.211	5.637.282	0,75
CH0404311687	Socgen 0.7% 18-26.02.25	5.000.000	CHF	5.010.100	4.700.000	0,63



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	1.000.000	EUR	1.123.482	1.158.807	0,16
				<b>27.543.256</b>	<b>24.314.581</b>	<b>3,27</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
CH0357520433	Anz Nz Intl 0.25% 17-22.09.25	1.000.000	CHF	1.000.550	956.250	0,13
CH0426621683	Barclays 1.125% 18-12.07.23	2.000.000	CHF	2.009.100	1.975.000	0,27
CH0461239094	Bnz Intl Ln 0.111% 20-24.07.28	3.000.000	CHF	3.000.000	2.802.750	0,38
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	850.000	EUR	926.727	792.874	0,11
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	5.000.000	EUR	7.663.119	6.155.524	0,82
CH0429659607	Lloyds Bk 1% 18-04.03.25	2.000.000	CHF	1.999.300	1.916.000	0,26
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	1.200.000	EUR	1.330.330	1.219.550	0,16
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	400.000	EUR	432.378	409.566	0,06
CH0488506699	Natwest Mar 0.125% 19-13.09.23	2.000.000	CHF	2.001.800	1.903.000	0,26
US80283LAJ26	Santander 4% 14-13.03.24	5.000.000	USD	5.042.957	4.998.752	0,66
XS0181816652	Vodafone 5.625% 03-04.12.25	3.500.000	GBP	8.468.312	4.993.702	0,67
CH0373314894	Wstp 0.125% 17-15.12.22	2.500.000	CHF	2.513.600	2.450.000	0,33
CH0306770600	Wstp 0.375% 16-05.02.24	1.000.000	CHF	1.017.051	985.500	0,13
				<b>37.405.224</b>	<b>31.558.468</b>	<b>4,24</b>
	<b>Honduras</b>					
CH0276581110	Cabei 0.194% 15-19.11.21	2.000.000	CHF	2.023.350	1.991.500	0,27
				<b>2.023.350</b>	<b>1.991.500</b>	<b>0,27</b>
	<b>Irlande</b>					
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	950.000	EUR	1.025.282	931.478	0,13
				<b>1.025.282</b>	<b>931.478</b>	<b>0,13</b>
	<b>Italie</b>					
US465410AH18	Italy 6.875% 93-27.09.23	4.000.000	USD	5.502.455	4.454.524	0,60
				<b>5.502.455</b>	<b>4.454.524</b>	<b>0,60</b>
	<b>Japon</b>					
XS0159205995	Dbj 1.7% 02-20.09.22	1.000.000.000	JPY	9.992.903	9.339.588	1,25
				<b>9.992.903</b>	<b>9.339.588</b>	<b>1,25</b>
	<b>Canada</b>					
CH0413618346	Cibc 0.1% 18-30.04.25	2.000.000	CHF	1.985.640	2.019.500	0,27
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	300.000	USD	293.407	253.303	0,03
US748148QR73	Quebec 7.5% 99-15.09.29	2.500.000	USD	3.567.839	3.732.567	0,50
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	850.000	EUR	964.036	856.872	0,12
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	1.200.000	USD	1.190.209	1.185.930	0,16
CH0441186514	Scotiabk 0.2% 18-19.11.25	2.000.000	CHF	2.000.000	2.030.500	0,27
CH0295653577	Scotiabk 0.3% 15-16.09.22	2.000.000	CHF	2.029.700	1.994.500	0,27
				<b>12.030.831</b>	<b>12.073.172</b>	<b>1,62</b>
	<b>Luxembourg</b>					
CH0398677689	Aroundtown 0.732% 18-30.01.25	3.000.000	CHF	3.000.000	2.852.250	0,38
XS0241594778	Bei 1.9% 06-26.01.26	250.000.000	JPY	3.141.798	2.527.816	0,34

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS0282506657	Bei 2.15% 07-18.1.27 Senior	700.000.000	JPY	8.223.868	7.319.675	0,98
XS0093667334	Bei 5.625%98-15.02.28	1.000.000	EUR	1.741.176	1.538.366	0,21
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	400.000	EUR	442.680	389.904	0,05
				<b>16.549.522</b>	<b>14.628.011</b>	<b>1,96</b>
	<b>Mexique</b>					
US191241AH15	Coca Co F 2.75% 20-22.01.30	500.000	USD	480.212	472.034	0,06
				<b>480.212</b>	<b>472.034</b>	<b>0,06</b>
	<b>Pays-Bas</b>					
CH0026302304	Abn 3.375% 06-15.08.31	1.000.000	CHF	1.091.700	1.340.250	0,18
CH0441004402	Achmea Hypo 0.5% 18-15.11.22	1.700.000	CHF	1.701.003	1.707.650	0,23
DE000A28RSR6	Allianz Fin 0.50% 20-14.01.31 Regs	800.000	EUR	859.871	778.322	0,10
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	3.000.000	CHF	3.003.750	2.763.750	0,37
XS0161488498	Deutsch.telek.7.5% 03- 24.01.33	1.000.000	EUR	1.822.841	1.724.356	0,23
CH0353428060	Enel Fin 0.55% 17-03.09.24	3.500.000	CHF	3.518.650	3.463.250	0,47
USN30707AJ75	Enel Fin 4.25% 18-14.09.23 Regs	1.000.000	USD	955.433	994.777	0,13
XS0177089298	Enel Inv 5.25% 03-29.09.23	2.000.000	EUR	3.584.419	2.445.584	0,33
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	400.000	EUR	456.400	428.905	0,06
CH0026620846	Rabobk 3.125% 06-15.09.26	6.000.000	CHF	6.892.350	6.823.499	0,91
XS2049616621	Siemens Fin 0.125% 19-5.9.29	1.000.000	EUR	1.083.955	963.889	0,13
US879385AD49	Telefonica 8.25% 00-15.9.30	5.000.000	USD	6.485.317	6.745.399	0,91
				<b>31.455.689</b>	<b>30.179.631</b>	<b>4,05</b>
	<b>Nigéria</b>					
CH0511762038	Africa Fina 0.522% 19-20.12.23	1.500.000	CHF	1.500.000	1.413.750	0,19
				<b>1.500.000</b>	<b>1.413.750</b>	<b>0,19</b>
	<b>Pologne</b>					
CH0385997074	Pko Bank 0.3% 17-02.11.21	7.500.000	CHF	7.536.850	7.387.500	0,99
				<b>7.536.850</b>	<b>7.387.500</b>	<b>0,99</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	200.000	EUR	226.613	219.718	0,03
				<b>226.613</b>	<b>219.718</b>	<b>0,03</b>
	<b>Suède</b>					
CH0406415304	Lansbk 0.2% 18-17.04.26	2.000.000	CHF	1.996.900	2.035.000	0,28
XS0191154961	Vattenf Tsy 5.375% 04-29.04.24	1.500.000	EUR	2.328.367	1.881.946	0,25
				<b>4.325.267</b>	<b>3.916.946</b>	<b>0,53</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0506668869	Ubs Group F 3% 19-perp	1.000.000	CHF	1.000.000	892.500	0,12
CH0525158371	Zuerich Ver 0.10% 20-27.08.32	2.000.000	CHF	2.008.720	1.820.000	0,24
				<b>3.008.720</b>	<b>2.712.500</b>	<b>0,36</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	700.000	EUR	748.871	719.534	0,10

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS2076079594	Bco Sab 0.625% 19-07.11.25	1.000.000	EUR	1.088.961	984.432	0,13
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	1.000.000	EUR	1.111.825	1.011.928	0,14
CH0438965540	Santan Cons 0.625% 18-24.10.22	2.000.000	CHF	2.001.980	1.944.500	0,26
CH0505011947	Santander 0.20% 19-19.11.27	1.000.000	CHF	1.000.000	893.750	0,12
				<b>5.951.637</b>	<b>5.554.144</b>	<b>0,75</b>
<b>Corée du Sud</b>						
CH0401007346	Eibk 0.253% 18-06.03.23	5.000.000	CHF	5.027.000	4.971.250	0,67
CH0419040917	Hycup 0.7325% 19-26.02.24	2.000.000	CHF	2.000.000	1.958.500	0,26
CH0461238856	Kor Railrd 0.0% 19-19.11.24	1.000.000	CHF	1.009.050	979.250	0,13
				<b>8.036.050</b>	<b>7.909.000</b>	<b>1,06</b>
<b>Venezuela</b>						
CH0204567322	Corp Andina 1.375% 13-11.02.21	1.000.000	CHF	1.053.675	1.005.750	0,14
				<b>1.053.675</b>	<b>1.005.750</b>	<b>0,14</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	400.000	USD	407.147	426.496	0,06
CH0314209369	Amgen 0.41% 16-08.03.23	2.500.000	CHF	2.527.600	2.512.500	0,34
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	1.350.000	EUR	1.472.321	1.340.104	0,18
US037833DN70	Apple Inc 2.05% 19-11.09.26	400.000	USD	391.877	397.810	0,05
CH0260769424	At&t Inc 1.375% 14-04.12.24	2.000.000	CHF	2.112.500	2.039.000	0,27
CH0474977722	Bac 0.252% 19-12.06.26	2.000.000	CHF	2.000.000	1.871.000	0,25
CH0365501474	Citigp 0.5% 17-22.11.24	4.000.000	CHF	4.025.700	3.864.000	0,52
CH0026791225	Citigroup I 0.75% 06-27.09.21	2.000.000	CHF	1.989.400	2.059.500	0,28
CH0467182405	Citigroup I 0.75% 19-02.04.26	4.000.000	CHF	4.040.780	3.840.000	0,52
CH0297974898	Coca Cola 1% 15-02.10.28	7.000.000	CHF	7.407.111	7.329.000	0,98
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	500.000	USD	476.733	458.343	0,06
CH0323735594	Eli Lilly 0.15% 16-24.05.24	5.000.000	CHF	4.992.550	4.952.500	0,67
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	800.000	EUR	865.874	811.827	0,11
XS2043678841	Gldm Sachs 0.125% 19-19.8.24 Regs	1.000.000	EUR	1.078.631	981.332	0,13
CH0379268672	Gs 0.5% 17-04.12.24	2.000.000	CHF	1.999.700	1.908.500	0,26
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	1.250.000	USD	1.222.750	1.077.827	0,14
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	6.500.000	USD	7.094.346	9.216.958	1,23
US459056LD78	Ibrd 7.625% 93-19.01.23	6.000.000	USD	10.153.655	6.939.251	0,93
CH0517825268	Jackson Nat 0.125% 20-14.07.28	2.000.000	CHF	2.001.700	1.800.500	0,24
CH0319415995	Jpm 0.45% 16-11.11.26	3.000.000	CHF	2.988.100	2.822.250	0,38
CH0272024669	Jpm 0.5% 15-04.12.23	5.000.000	CHF	5.076.600	4.961.250	0,67
CH0338330456	Mcdonalds 0.17% 16-04.10.24	9.000.000	CHF	8.942.200	8.862.750	1,19
US58013MFM10	Mcdonalds 2.125% 20-01.03.30	400.000	USD	382.014	359.882	0,05
US58933YAR62	Merck 2.75% 15-10.02.25	7.000.000	USD	6.508.441	7.183.016	0,96
CH0482172340	Met Life 0.125% 19-11.06.27	4.000.000	CHF	4.000.000	3.801.000	0,51
CH0254282202	Met Life 1% 14-19.09.22	6.000.000	CHF	6.268.875	5.958.000	0,80
XS1110874820	Met Life 1.25% 14-17.09.21	3.500.000	EUR	3.546.438	3.716.055	0,50
CH0360172693	Mondelez 0.617% 17-30.09.24	2.000.000	CHF	1.995.100	1.953.500	0,26
CH0383104335	Nestle 0.25% 17-04.10.27	5.000.000	CHF	4.940.100	4.948.750	0,66
CH0471297959	Ny Life Gbl 0.25% 19-18.10.27 Regs	2.000.000	CHF	2.006.960	1.917.000	0,26
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	1.250.000	EUR	1.362.068	1.114.117	0,15
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	300.000	USD	295.420	304.479	0,04

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US9128283R96	Usa 0.5% 18-15.01.28 /infl	7.000.000	USD	6.843.747	7.410.761	1,00
XS1030900242	Verizon Com 3.25% 14-17.02.26	4.000.000	EUR	5.232.182	4.674.933	0,63
CH0367206668	Verizon 0.375% 17-31.05.23 Regs	6.000.000	CHF	6.030.100	5.944.500	0,80
				<b>122.678.720</b>	<b>119.758.691</b>	<b>16,08</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>353.672.397</b>	<b>329.249.891</b>	<b>44,22</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	3.564	EUR	420.651	194.293	0,03
				<b>420.651</b>	<b>194.293</b>	<b>0,03</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	23.142	GBP	259.081	154.589	0,02
				<b>259.081</b>	<b>154.589</b>	<b>0,02</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	13.096	USD	76.242	64.242	0,01
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	11.040	USD	339.587	254.226	0,03
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	3.050	USD	381.083	304.044	0,04
US6819361006	Omega Healthcare Investors	11.002	USD	438.467	282.518	0,04
US8666741041	Sun Communities Inc	1.059	USD	156.242	127.926	0,02
US92276F1003	Ventas Inc.	5.956	USD	427.216	154.441	0,02
				<b>1.818.837</b>	<b>1.187.397</b>	<b>0,16</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>2.498.569</b>	<b>1.536.279</b>	<b>0,21</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>611.246.056</b>	<b>577.573.057</b>	<b>77,57</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00BVXBYN70	Gam St Chf -ins- /cap	2.691.937	CHF	26.848.295	28.251.878	3,79
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	1.304.864	USD	8.797.212	8.389.456	1,13
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	520.097	USD	24.679.328	23.882.822	3,21
				<b>60.324.835</b>	<b>60.524.156</b>	<b>8,13</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	214.443	USD	23.174.119	23.296.347	3,14
LU1637934073	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Chf	234.479	CHF	22.582.634	22.144.159	2,97

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	129.800	USD	13.255.940	11.270.253	1,51
				<b>59.012.693</b>	<b>56.710.759</b>	<b>7,62</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>119.337.528</b>	<b>117.234.915</b>	<b>15,75</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>119.337.528</b>	<b>117.234.915</b>	<b>15,75</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>730.583.584</b>	<b>694.807.972</b>	<b>93,32</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Suisse	21,90	Banques et autres institutions financières	18,24
Etats-Unis d'Amérique	20,45	Fonds d'investissements	15,75
Luxembourg	9,58	Pharmacie et cosmétique	10,35
Irlande	8,51	Holdings et sociétés financières	10,18
Royaume-Uni	5,32	Alimentation, boissons	6,22
Pays-Bas	4,39	Supranational	6,00
France	4,12	Transmission de nouvelles	5,02
Japon	3,58	Assurances	3,08
Allemagne	2,97	Obligations d'Etats et de villes étrangers	2,98
Canada	2,88	Electrotechnique, électronique	2,25
Côte d'Ivoire	1,54	Chimie	1,56
Australie	1,20	Construction, matériel de construction	1,50
Corée du Sud	1,06	Gastronomie	1,28
Chili	1,00	Mécanique, outillage	0,97
Pologne	0,99	Internet Software	0,90
Espagne	0,96	Commerce de détail et grands magasins	0,83
Italie	0,76	Sociétés immobilières	0,79
Suède	0,53	Energie et service des eaux	0,73
Bermudes	0,44	Articles de bureau et ordinateurs	0,64
Honduras	0,27	Pétrole	0,62
Nigéria	0,19	Santé, éducation et services sociaux	0,49
Chine	0,17	Services divers	0,47
Venezuela	0,14	Biotechnologie	0,44
Jersey	0,07	Circulation et transport	0,43
Belgique	0,06	Véhicules routiers	0,26
Portugal	0,06	Arts graphiques et maisons d'édition	0,25
Mexique	0,06	Biens de consommation divers	0,23
Finlande	0,06	Textile et habillement	0,13
Liechtenstein	0,05	Industrie horlogère	0,12
Curacao	0,01	Métaux non ferreux	0,12
	<b>93,32</b>	Industrie aéronautique et spatiale	0,12
		Papier et bois	0,08
		Caoutchouc et pneus	0,07
		Service d'environnement et de recyclage	0,05
		Photographie et optique	0,04
		Métaux et pierres précieuses	0,04
		Maisons de commerce diverses	0,03
		Mines, aciéries	0,02
		Divers	0,02
		Agriculture et pêche	0,02
			<b>93,32</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0974264930	Ageas Nv	6.639	EUR	346.140	251.684	0,16
BE0003818359	Galapagos Genomics Nv	596	EUR	95.046	107.876	0,07
BE0003565737	Kbc Groupe Sa	596	EUR	27.867	25.044	0,02
BE0003826436	Telenet Group Holding	4.302	EUR	183.057	118.047	0,08
BE0003739530	Ucb	2.864	EUR	201.399	226.256	0,15
BE0974320526	Umicore Sa	928	EUR	31.464	29.557	0,02
				<b>884.973</b>	<b>758.464</b>	<b>0,50</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG169621056	Bunge Ltd	892	USD	30.167	33.355	0,02
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	1.270	USD	68.244	69.446	0,05
				<b>98.411</b>	<b>102.801</b>	<b>0,07</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	2.009	EUR	496.096	413.653	0,28
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	4.064	EUR	786.636	637.560	0,42
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	1.904	EUR	209.572	176.234	0,12
DE0005190003	Bmw-bayer.motorenwerke	2.525	EUR	184.497	118.965	0,08
DE000A1DAH00	Brenntag	1.434	EUR	46.956	48.512	0,03
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	1.600	EUR	156.667	141.360	0,09
DE000CBK1001	Commerzbank Akt Nach Kap	6.721	EUR	24.935	22.236	0,01
DE0005439004	Continental Ag	1.682	EUR	112.745	110.356	0,07
DE0006062144	Covestro Ag	3.056	EUR	103.316	85.171	0,06
DE0007100000	Daimler Ag / Namen-akt.	1.818	EUR	54.121	50.031	0,03
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	15.646	EUR	100.666	93.391	0,06
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	2.580	EUR	327.068	322.500	0,21
DE0005552004	Deutsche Post Ag	8.220	EUR	266.085	203.651	0,14
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	35.590	EUR	435.499	420.460	0,28
DE000ENAG999	E.on Se	12.443	EUR	110.274	117.474	0,08
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-.	8.446	EUR	222.248	161.065	0,11
DE0005785604	Fresenius Se & Co Kгаа	2.364	EUR	79.442	80.211	0,05
DE0006602006	Gea Group Ag	4.535	EUR	126.545	84.918	0,06
DE0006047004	Heidelbergcement Ag	1.396	EUR	90.654	54.570	0,04
DE0006048432	Henkel / Vorzug	3.780	EUR	351.744	276.696	0,18
DE000KGX8881	Kion Group	3.876	EUR	242.209	152.869	0,10
DE0005470405	Lanxess Ag	2.928	EUR	104.282	106.638	0,07
DE0006599905	Merck Kгаа	2.027	EUR	188.701	189.768	0,13
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	1.858	EUR	360.809	342.058	0,23
DE0006969603	Puma Se	2.595	EUR	156.060	141.168	0,09
DE0007164600	Sap Se	8.003	EUR	744.773	822.709	0,56
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	7.547	EUR	826.197	584.666	0,39
DE000SHL1006	Siemens Healthineers Ag	828	EUR	35.062	29.845	0,02
DE000SYM9999	Symrise Ag	2.193	EUR	215.736	186.405	0,12
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	60.065	EUR	192.631	135.687	0,09

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
DE000UNSE018	Uniper Se	4.095	EUR	106.658	92.097	0,06
DE000A1ML7J1	Vonovia Se /namen	1.043	EUR	46.149	46.789	0,03
				<b>7.505.033</b>	<b>6.449.713</b>	<b>4,29</b>
	<b>Finlande</b>					
FI0009007132	Fortum Corporation	10.746	EUR	163.421	143.728	0,10
FI0009007835	Metso Corp	7.999	EUR	238.385	173.738	0,11
FI0009013296	Neste Oil Oyj	5.340	EUR	165.569	164.739	0,11
FI0009000681	Nokia Oy	53.491	EUR	152.151	153.466	0,10
FI0009014377	Orion Corp (new)- Shs-b-	2.432	EUR	93.524	90.665	0,06
				<b>813.050</b>	<b>726.336</b>	<b>0,48</b>
	<b>France</b>					
FR0000120073	Air Liquide	4.721	EUR	555.549	550.705	0,37
FR0000051732	Atos Act.	810	EUR	50.914	50.009	0,03
FR0000120628	Axa	23.427	EUR	503.153	369.865	0,25
FR0000131104	Bnp Paribas	13.171	EUR	473.909	362.334	0,24
FR0000039299	Bolloré Sa	53.267	EUR	204.911	133.700	0,09
FR0000120503	Bouygues	5.899	EUR	230.200	157.621	0,10
FR0006174348	Bureau Veritas	9.298	EUR	231.223	160.948	0,11
FR0000125338	Capgemini Se	1.660	EUR	120.796	127.820	0,09
FR0000120222	Cnp Assurances	15.036	EUR	290.875	134.121	0,09
FR0000120644	Danone.	6.798	EUR	391.821	398.635	0,27
FR0010242511	Edf	4.536	EUR	34.127	32.596	0,02
FR0000130452	Eiffage Sa	2.314	EUR	211.507	149.253	0,10
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	3.345	EUR	474.473	328.747	0,22
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	12.893	EUR	244.454	122.819	0,08
FR0010533075	Getlink Se	2.733	EUR	29.966	30.036	0,02
FR0000052292	Hermès International	435	EUR	299.920	273.528	0,18
FR0010259150	Ipsen	753	EUR	35.865	35.527	0,02
FR0000121485	Kering Sa	738	EUR	400.483	351.214	0,23
FR0000120321	L Oreal	2.442	EUR	583.970	583.394	0,39
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	2.992	EUR	173.062	174.972	0,12
FR0000121261	Michelin B /nom.	2.825	EUR	241.777	228.995	0,15
FR0000133308	Orange	4.693	EUR	53.810	52.257	0,03
FR0000121501	Peugeot Sa	4.805	EUR	59.288	58.453	0,04
FR0000125007	Saint-gobain	11.329	EUR	369.788	251.107	0,17
FR0000120578	Sanofi	10.207	EUR	725.105	817.988	0,55
FR0000121972	Schneider Electric Se	5.937	EUR	597.685	466.529	0,31
FR0000121220	Sodexo	559	EUR	55.571	34.457	0,02
FR0000130809	Ste Gen.paris -a-	7.619	EUR	132.239	116.936	0,08
FR0010613471	Suez Environnement Cie	16.857	EUR	199.168	156.366	0,10
FR0000051807	Teleperform.se	1.202	EUR	272.508	228.140	0,15
FR0000120271	Total Sa	23.007	EUR	1.121.421	814.218	0,54
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	894	EUR	55.943	60.059	0,04
FR0000124141	Veolia Environnement	11.013	EUR	263.384	214.478	0,14
FR0000125486	Vinci.	2.116	EUR	167.356	159.546	0,11
				<b>9.856.221</b>	<b>8.187.373</b>	<b>5,45</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Royaume-Uni</b>						
GB0006731235	Associated British Foods Plc	7.342	GBP	230.298	150.505	0,10
GB0009895292	Astrazeneca Plc	1.692	GBP	127.729	137.973	0,09
GB0031348658	Barclays Plc	54.857	GBP	63.321	58.340	0,04
GB0007980591	Bp Plc	50.763	GBP	188.004	197.450	0,13
GB0031743007	Burberry Group Plc	4.333	GBP	64.044	64.854	0,04
GB00B033F229	Centrica Plc	67.127	GBP	32.215	28.886	0,02
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	2.803	GBP	34.227	40.038	0,03
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	10.421	GBP	169.390	178.363	0,12
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	11.374	GBP	63.286	58.386	0,04
GB0031274896	Marks And Spencer /new	61.967	GBP	137.381	69.494	0,05
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	95.474	GBP	187.065	98.720	0,07
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	10.417	GBP	99.509	47.087	0,03
GB0032089863	Next Plc	691	GBP	48.182	31.797	0,02
GB0006825383	Persimmon Plc	4.040	GBP	133.134	87.496	0,06
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	518	GBP	32.502	36.000	0,02
GB00B2B0DG97	Relx Plc	9.646	GBP	216.938	188.796	0,13
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	4.297	GBP	179.118	180.564	0,12
GB00B8C3BL03	Sage Grp	7.148	GBP	45.833	47.803	0,03
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	4.621	GBP	71.351	74.909	0,05
GB0004082847	Standard Chartered Plc	15.210	GBP	78.572	76.625	0,05
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	108.843	GBP	181.102	144.523	0,10
GB00B10RZP78	Unilever Plc	4.639	GBP	249.127	213.651	0,13
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	144.217	GBP	267.864	184.159	0,12
				<b>2.900.192</b>	<b>2.396.419</b>	<b>1,59</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	1.183	USD	190.902	176.019	0,12
IE00BY9D5467	Allergan Plc	260	USD	40.569	41.965	0,03
IE00BD1RP616	Bank Of Ireland Group Plc	25.475	EUR	50.438	43.919	0,03
IE0001827041	Crh Plc	6.575	EUR	176.336	163.389	0,11
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	2.383	USD	167.806	168.727	0,11
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	3.506	USD	126.933	86.144	0,06
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	2.080	USD	175.665	170.950	0,11
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	7.311	EUR	240.780	188.038	0,12
				<b>1.169.429</b>	<b>1.039.151</b>	<b>0,69</b>
<b>Italie</b>						
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	19.127	EUR	352.965	237.366	0,16
IT0003128367	Enel	56.239	EUR	285.037	356.499	0,25
IT0003132476	Eni Spa Roma	32.573	EUR	464.780	300.323	0,20
NL0011585146	Ferrari N.v.	1.311	EUR	183.436	185.572	0,12
IT0000072618	Intesa Sanpaolo Spa	32.246	EUR	52.176	47.995	0,03
IT0003796171	Poste Italiane Spa	20.323	EUR	205.607	156.894	0,10
IT0003497176	Telecom Italia Spa/risp.n-cv	331.388	EUR	168.439	119.465	0,08
IT0005239360	Unicredit Spa	11.288	EUR	95.301	80.675	0,05
				<b>1.807.741</b>	<b>1.484.789</b>	<b>0,99</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Japon</b>						
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	1.800	JPY	42.504	40.482	0,03
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	3.000	JPY	46.469	50.919	0,03
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	13.000	JPY	166.180	183.388	0,12
JP3242800005	Canon Inc.	2.200	JPY	45.187	43.813	0,03
JP3566800003	Central Japan Railway Co	300	JPY	45.114	43.865	0,03
JP3511800009	Chiba Bank	12.200	JPY	62.252	48.716	0,03
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	8.400	JPY	198.300	163.173	0,11
JP3551500006	Denso Corp	2.500	JPY	75.252	73.679	0,05
JP3160400002	Eisai Co.ltd	1.000	JPY	62.911	66.954	0,04
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	7.600	JPY	125.875	124.342	0,08
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	100	JPY	41.792	37.306	0,02
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	2.600	JPY	53.187	53.754	0,04
JP3818000006	Fujitsu Ltd	1.100	JPY	88.201	90.588	0,06
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	2.900	JPY	27.944	26.686	0,02
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	1.400	JPY	75.518	94.315	0,06
JP3788600009	Hitachi Ltd	7.000	JPY	230.619	185.735	0,12
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	5.400	JPY	116.059	110.778	0,07
JP3837800006	Hoya Corp	300	JPY	22.318	23.300	0,02
JP3294460005	Inpex Corp	26.100	JPY	231.165	134.143	0,09
JP3496400007	Kddi Corp.	5.500	JPY	147.737	148.117	0,10
JP3982100004	Lawson Inc	2.900	JPY	143.959	145.179	0,10
JP3626800001	Lixil Group Shs	13.000	JPY	201.559	147.611	0,10
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	4.800	JPY	27.028	26.048	0,02
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	9.400	JPY	132.012	126.573	0,08
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	22.200	JPY	128.245	99.705	0,07
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	1.900	JPY	30.461	30.003	0,02
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	5.800	JPY	179.011	148.117	0,10
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	500	JPY	22.826	23.098	0,02
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	200	JPY	69.259	70.255	0,05
JP3743000006	Nippon Meat Packers	1.400	JPY	43.730	44.498	0,03
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	4.500	JPY	65.471	68.457	0,05
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	3.200	JPY	164.183	130.346	0,09
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	8.900	JPY	183.107	131.862	0,09
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	6.700	JPY	165.596	191.011	0,13
JP3201200007	Olympus Corp	6.400	JPY	61.953	84.394	0,06
JP3200450009	Orix Corp	3.700	JPY	42.842	40.622	0,03
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	1.000	JPY	32.727	35.719	0,02
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	11.500	JPY	181.251	139.122	0,09
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	2.200	JPY	179.768	199.284	0,13
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	1.000	JPY	41.734	44.887	0,03
JP3435000009	Sony Corp	4.600	JPY	285.776	249.351	0,16
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	21.400	JPY	58.334	57.992	0,04
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	5.400	JPY	171.706	142.415	0,09
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	3.200	JPY	87.254	93.471	0,06
JP3336560002	Suntory B & F	3.700	JPY	125.383	127.598	0,08
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Tokyo	8.400	JPY	214.993	131.191	0,09
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	4.100	JPY	207.594	171.333	0,11
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	200	JPY	37.244	34.368	0,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3592200004	Toshiba Corp	2.000	JPY	41.394	40.185	0,03
JP3633400001	Toyota Motor Corp	1.700	JPY	97.456	93.300	0,06
JP3933800009	Z Holdings Corporation	12.800	JPY	48.098	37.605	0,03
				<b>5.376.538</b>	<b>4.849.653</b>	<b>3,23</b>
<b>Jersey</b>						
GB00B19NLV48	Experian Plc	1.453	GBP	36.207	36.961	0,02
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	1.340	GBP	95.910	76.561	0,06
				<b>132.117</b>	<b>113.522</b>	<b>0,08</b>
<b>Canada</b>						
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	5.937	CAD	211.781	59.873	0,04
CA0467894006	Atco Ltd - Cl I Non Voting	4.007	CAD	89.216	99.984	0,07
CA05534B7604	Bce Inc	4.355	CAD	164.465	160.980	0,11
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	8.460	CAD	211.750	104.276	0,07
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	2.175	CAD	216.648	118.292	0,08
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	5.028	CAD	97.635	108.301	0,07
CA15135U1093	Cenovus Energy	10.782	CAD	82.936	19.607	0,01
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	2.253	CAD	102.169	109.911	0,07
CA1254911003	Ci Financial Corp	11.994	CAD	178.620	107.286	0,07
CA2908761018	Emera Inc	1.089	CAD	35.427	38.699	0,03
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	7.878	CAD	136.659	138.869	0,09
CA9611485090	George Weston Ltd	1.192	CAD	72.871	76.804	0,05
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	5.555	CAD	188.143	157.356	0,10
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	2.480	CAD	74.400	65.820	0,04
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	803	CAD	38.940	37.302	0,02
CA5592224011	Magna International Inc	1.882	CAD	52.800	54.118	0,04
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	20.836	CAD	386.682	235.741	0,17
CA67077M1086	Nutrien Ltd	1.215	CAD	34.142	37.428	0,02
CA6837151068	Open Text Corp	2.601	CAD	77.628	81.955	0,05
CA7392391016	Power Corp.canada	10.425	CAD	224.266	151.125	0,10
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	2.436	CAD	98.010	88.454	0,06
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	1.222	CAD	66.993	68.206	0,05
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	7.262	CAD	315.258	210.499	0,14
CA8672241079	Suncor Energy	7.095	CAD	87.325	102.034	0,07
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	1.028	CAD	39.461	39.382	0,03
CA92938W2022	Wsp Global Inc	599	CAD	28.282	30.652	0,02
				<b>3.312.507</b>	<b>2.502.954</b>	<b>1,67</b>
<b>Liechtenstein</b>						
LI0355147575	Liechtenst	521	CHF	28.665	26.500	0,02
				<b>28.665</b>	<b>26.500</b>	<b>0,02</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0156801721	Tenaris Sa	5.800	EUR	31.220	32.364	0,02
				<b>31.220</b>	<b>32.364</b>	<b>0,02</b>
<b>Pays-Bas</b>						
NL0012969182	Adyen B.v.	163	EUR	126.766	125.608	0,08

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
NL0013267909	Akzo Nobel	2.619	EUR	147.131	157.166	0,10
NL0010273215	Asml Holding Nv	3.788	EUR	848.591	918.400	0,61
NL0012059018	Exor N.v.	4.113	EUR	231.450	193.311	0,13
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.v	9.884	EUR	84.823	64.958	0,04
NL0011821202	Ing Group Nv	5.378	EUR	32.181	25.715	0,02
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.v.	662	EUR	46.512	45.479	0,03
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	12.848	EUR	164.982	273.470	0,18
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	14.992	EUR	38.521	32.623	0,02
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	10.643	EUR	351.129	392.886	0,26
NL0009538784	Nxp Semiconductor	2.497	USD	266.107	188.723	0,13
NL0013654783	Prosus Bearer Rg Shs -n-	2.423	EUR	154.465	153.012	0,10
NL0000379121	Randstad Holding (eur 0.1)	2.292	EUR	72.255	73.734	0,05
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	12.489	EUR	222.343	248.219	0,17
NL0000388619	Unilever Nv.	13.962	EUR	718.400	625.567	0,42
NL0000395903	Wolters Kluwer Nv	4.165	EUR	268.077	267.310	0,18
				<b>3.773.733</b>	<b>3.786.181</b>	<b>2,52</b>
	<b>Autriche</b>					
AT0000730007	Andritz Ag Graz	899	EUR	24.564	25.693	0,02
AT0000652011	Erste Group Bank Ag	3.668	EUR	70.675	61.935	0,04
				<b>95.239</b>	<b>87.628</b>	<b>0,06</b>
	<b>Portugal</b>					
PTBES0AM0007	Banco Espirito Santo Sa/reg	429.800	EUR	413.067	0	0,00
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	38.938	EUR	119.604	142.435	0,09
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	2.539	EUR	34.359	26.393	0,02
				<b>567.030</b>	<b>168.828</b>	<b>0,11</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0012221716	Abb	10.634	CHF	171.119	170.331	0,11
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	2.154	CHF	129.589	77.383	0,05
CH0432492467	Alcon Inc.	1.849	CHF	67.682	85.915	0,06
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	3.291	CHF	46.050	16.895	0,01
CH0012410517	Baloise Holding/namen	661	CHF	84.297	79.010	0,05
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	37	CHF	59.665	67.612	0,04
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	14	CHF	49.159	82.551	0,05
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	19.846	CHF	348.585	149.549	0,10
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	73	CHF	34.275	46.001	0,03
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	44	CHF	53.541	48.532	0,03
CH0114405324	Garmin	2.048	USD	183.060	139.912	0,09
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	307	CHF	114.894	123.188	0,08
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	39	CHF	71.916	110.023	0,07
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	52	CHF	39.989	56.426	0,04
CH0023868554	Implenia Ag	828	CHF	55.961	26.673	0,02
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	85	CHF	44.100	50.441	0,03
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	3.142	CHF	142.017	104.650	0,07
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	646	CHF	41.273	40.525	0,03
CH0108503795	Meyer Burger	28.879	CHF	41.924	4.192	0,00
CH0038863350	Nestle / Act Nom	11.704	CHF	601.281	1.096.377	0,74

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	11.696	CHF	625.486	879.697	0,59
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	3.616	CHF	638.330	1.069.666	0,72
CH0024638196	Schindler Holding/partic	535	CHF	96.379	107.036	0,07
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	37	CHF	38.800	32.726	0,02
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	7.721	CHF	70.169	105.308	0,07
CH0418792922	Sika Ltd	613	CHF	71.012	92.356	0,06
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	618	CHF	81.404	101.521	0,07
CH0002178181	Stadler Rail Ag	545	CHF	18.285	22.947	0,02
CH0126881561	Swiss Re-namen	3.039	CHF	229.408	213.431	0,14
CH0008742519	Swisscom /nam.	386	CHF	167.545	189.138	0,13
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	893	CHF	57.562	32.031	0,02
CH0244767585	Ubs Group Ag	26.187	CHF	422.418	223.133	0,15
CH0311864901	Vat Group Ltd	400	CHF	41.805	50.488	0,03
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	127	CHF	6.360	5.694	0,00
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	1.001	CHF	269.245	323.784	0,22
				<b>5.214.585</b>	<b>6.025.142</b>	<b>4,01</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0167050915	Acs	80	EUR	0	1.425	0,00
ES0105046009	Aena Sme Sa	1.662	EUR	288.725	165.402	0,11
ES0113900J37	Banco Santander --- Reg.shs	70.950	EUR	294.094	157.367	0,10
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	92.856	EUR	303.081	270.722	0,18
ES0130960018	Enagas	8.245	EUR	203.592	149.193	0,10
ES0130670112	Endesa Sa	9.422	EUR	225.869	183.446	0,12
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	55.682	EUR	398.839	500.248	0,34
ES0148396007	Inditex	13.885	EUR	376.264	328.519	0,22
ES0173093024	Red Electrica Corporacion. Sa	1.762	EUR	26.082	28.835	0,02
ES0173516115	Repsol Sa	29.660	EUR	374.311	247.127	0,16
ES0178430E18	Telefonica Sa	9.118	EUR	57.361	38.054	0,03
				<b>2.548.218</b>	<b>2.070.338</b>	<b>1,38</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US00287Y1091	Abbvie Inc	2.582	USD	207.440	179.287	0,12
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	877	USD	55.418	73.125	0,05
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	147	USD	149.515	155.668	0,10
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	150	USD	157.399	158.962	0,11
US0231351067	Amazon Com Inc	198	USD	339.909	351.829	0,23
US0258161092	American Express Co.	1.680	USD	181.039	131.078	0,09
US0311621009	Amgen Inc	705	USD	143.357	130.257	0,09
US0378331005	Apple Inc	2.273	USD	432.750	526.773	0,34
US0382221051	Applied Materials Inc	2.159	USD	122.507	90.158	0,06
US03965L1008	Arconic Inc	7.382	USD	165.455	108.047	0,07
US00206R1023	At & T	8.222	USD	293.885	218.429	0,15
US0865161014	Best Buy Co Inc.	903	USD	50.573	46.909	0,03
US09062X1037	Biogen Inc	112	USD	29.469	32.294	0,02
US09247X1019	Blackrock Inc	144	USD	54.649	57.740	0,04
US1011371077	Boston Scientific Corp.	1.721	USD	47.542	51.179	0,03
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	3.572	USD	215.506	181.457	0,12
US12508E1010	Cdk Global Inc	983	USD	31.003	29.430	0,02
US1567821046	Cerner Corp	1.405	USD	90.926	80.657	0,05

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	4.193	USD	116.644	150.218	0,10
US1729674242	Citigroup Inc	2.272	USD	128.279	87.215	0,06
US1912161007	Coca-cola Co.	5.315	USD	204.191	214.344	0,14
US20825C1045	Conocophillips	1.547	USD	44.192	43.425	0,03
US2310211063	Cummins Inc	455	USD	53.676	56.114	0,04
US25470F3029	Discovery Com Inc / -c-	1.714	USD	29.783	27.399	0,02
US2600031080	Dover Corp.	2.321	USD	188.219	177.557	0,12
US2774321002	Eastman Chemical Co	876	USD	37.674	37.188	0,02
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	8.056	USD	172.112	106.092	0,07
US30303M1027	Facebook Inc -a-	1.086	USD	156.630	165.090	0,11
US34354P1057	Flowserve Corp	1.104	USD	23.444	24.037	0,02
US3156161024	F5 Networks Inc.	1.199	USD	147.389	116.518	0,08
US3696041033	General Electric Co	5.098	USD	35.584	36.891	0,02
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	353	USD	22.704	24.051	0,02
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	179	USD	25.638	25.219	0,02
US4361061082	Hollyfrontier Corp	2.016	USD	99.269	45.033	0,03
US4364401012	Hologic Inc	1.095	USD	32.615	35.028	0,02
US4370761029	Home Depot Inc.	201	USD	33.731	34.203	0,02
US4592001014	Ibm Corp	800	USD	78.184	80.879	0,05
US4612021034	Intuit	207	USD	44.451	43.390	0,03
US4781601046	Johnson & Johnson	2.399	USD	305.817	286.699	0,19
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	532	USD	66.845	48.960	0,03
US4878361082	Kellogg Co	976	USD	61.978	53.361	0,04
US4943681035	Kimberly Clark Corp	1.288	USD	164.180	150.099	0,10
US5010441013	Kroger Co.	939	USD	24.223	25.776	0,02
US5128071082	Lam Research Corp	477	USD	122.779	104.334	0,07
US5312294094	Liberty Media Corp	1.410	USD	66.390	40.723	0,03
US5324571083	Lilly (eli) & Co	317	USD	35.690	40.077	0,03
US5018892084	Lkq	1.643	USD	30.339	30.711	0,02
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	903	USD	96.681	70.816	0,05
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	605	USD	133.722	133.191	0,09
US58933Y1055	Merck	1.566	USD	107.280	109.809	0,07
US59156R1086	Metlife Inc	5.892	USD	250.542	164.154	0,11
US5949181045	Microsoft Corp.	4.408	USD	413.764	633.570	0,41
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	1.598	USD	68.031	72.935	0,05
US61174X1090	Monster Beverage Corp	979	USD	48.503	50.197	0,03
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	230	USD	28.383	27.862	0,02
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	879	USD	38.582	36.274	0,02
US6541061031	Nike Inc B	1.125	USD	82.067	84.833	0,06
US65473P1057	Nisource Inc	2.123	USD	44.750	48.313	0,03
US67066G1040	Nvidia Corp.	286	USD	64.858	68.708	0,05
US7010941042	Parker-hannifin	582	USD	67.991	68.811	0,05
US7170811035	Pfizer Inc.	2.033	USD	55.842	60.476	0,04
US6935061076	Ppg Industries Inc.	920	USD	72.804	70.095	0,05
US69351T1060	Ppl Corp	3.462	USD	71.056	77.869	0,05
US7458671010	Pultegroup Inc	7.015	USD	228.361	142.697	0,09
US74736K1016	Qorvo Inc	534	USD	47.332	39.240	0,03
US7475251036	Qualcomm Inc.	1.651	USD	133.126	101.791	0,07
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	991	USD	84.246	72.524	0,05
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	61	USD	24.205	27.146	0,02



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US7591EP1005	Regions Financial Corp	19.338	USD	284.577	158.088	0,11
US7607591002	Republic Services Inc.	939	USD	62.196	64.235	0,04
US78409V1044	S&p Global Shs	750	USD	180.044	167.498	0,11
US87165B1035	Synchrony Financial	2.073	USD	60.525	30.398	0,02
US8716071076	Synopsys Inc.	312	USD	34.948	36.621	0,02
US8718291078	Sysco Corp.	2.265	USD	153.704	94.192	0,06
US87612E1064	Target Corp	1.042	USD	65.230	88.289	0,06
US8725401090	Tjx Companies Inc	2.919	USD	159.018	127.188	0,08
US89400J1079	Transunion	630	USD	38.256	37.998	0,03
US9078181081	Union Pacific Corp.	269	USD	33.010	34.577	0,02
US9130171096	United Technologies Corp	1.728	USD	153.465	148.555	0,10
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	419	USD	90.714	95.229	0,06
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc	246	USD	23.814	23.016	0,02
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	127	USD	24.635	27.541	0,02
US92826C8394	Visa Inc -a	1.200	USD	179.243	176.208	0,12
US9285634021	Vmware Inc	261	USD	28.002	28.806	0,02
US9297401088	Wabtec Corp	698	USD	30.096	30.617	0,02
US9633201069	Whirlpool Corp.	802	USD	101.110	62.713	0,04
US9884981013	Yum Brands Shs	849	USD	57.121	53.025	0,04
				<b>9.242.826</b>	<b>8.560.015</b>	<b>5,70</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>55.357.728</b>	<b>49.368.171</b>	<b>32,86</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
CH0482172357	Nat Aus Bk 0.125% 19-21.06.27	500.000	CHF	446.950	448.949	0,30
CH0340912168	Transurban 0.65% 16-02.11.26	400.000	CHF	335.473	347.480	0,23
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	350.000	EUR	349.580	332.472	0,22
US961214EL30	Westpac Bk 2.65% 20-16.01.30	100.000	USD	90.030	90.926	0,06
				<b>1.222.033</b>	<b>1.219.827</b>	<b>0,81</b>
<b>Belgique</b>						
BE0000346552	Belgium 1.25% 18-22.04.33 Regs	2.000.000	EUR	2.277.500	2.266.020	1,51
				<b>2.277.500</b>	<b>2.266.020</b>	<b>1,51</b>
<b>Caïmans (Iles)</b>						
US88032XAN49	Tencent Hol 3.975% 19-11.04.29	700.000	USD	677.233	711.815	0,47
				<b>677.233</b>	<b>711.815</b>	<b>0,47</b>
<b>Chili</b>						
US05968AAG13	Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	200.000	USD	178.739	170.987	0,11
				<b>178.739</b>	<b>170.987</b>	<b>0,11</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	600.000	USD	532.800	583.448	0,39
				<b>532.800</b>	<b>583.448</b>	<b>0,39</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Allemagne</b>						
XS2101357072	Fresenius 0.75% 20-15.01.28	700.000	EUR	696.598	659.120	0,44
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	700.000	USD	633.367	680.198	0,45
XS2102932055	Merck Fin Ser 0.5% 20-16.07.28	400.000	EUR	398.544	380.248	0,25
				<b>1.728.509</b>	<b>1.719.566</b>	<b>1,14</b>
<b>Côte d'Ivoire</b>						
XS0043037505	Afdb 7.375% 93-06.04.23	300.000	USD	288.780	326.874	0,22
				<b>288.780</b>	<b>326.874</b>	<b>0,22</b>
<b>France</b>						
FR0013459757	C Fr Fi Loc 0.10% 19-13.11.29	500.000	EUR	499.405	494.090	0,33
FR0013463676	Essilor 0.75% 19-27.11.31	500.000	EUR	492.685	462.815	0,31
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	500.000	EUR	660.125	668.335	0,44
FR0013398229	Gdf Suez 3.25% 19-perp	100.000	EUR	98.646	99.321	0,07
XS0144628053	Snfc 5.375% 02-18.03.27	800.000	GBP	1.235.804	1.167.027	0,78
FR0013410818	Socgen 1.75% 19-22.03.29	1.000.000	EUR	1.078.390	948.510	0,63
FR0013424868	Vivendi 0.625% 19-11.06.25	200.000	EUR	199.824	195.046	0,13
				<b>4.264.879</b>	<b>4.035.144</b>	<b>2,69</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	850.000	EUR	846.303	746.836	0,50
XS1822828122	Glaxosmithk 1.25% 18-21.05.26	500.000	EUR	503.400	508.590	0,34
US53944YAF07	Lloyds Bk 4.45% 18-08.05.25	1.000.000	USD	979.435	940.057	0,63
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	600.000	EUR	599.460	574.368	0,38
XS2104915033	Natl Grid 0.19% 20-20.01.25	250.000	EUR	250.000	241.115	0,16
XS1788515606	Natwest Mark 1.75% 18-02.03.26	1.000.000	EUR	1.025.999	944.699	0,62
XS0206361221	Network Rail 4.75% 04-29.11.35	200.000	GBP	295.159	346.040	0,23
GB00B24FF097	Uk 4.75% 07-07.12.30	200.000	GBP	301.528	330.118	0,22
XS2016070430	Wstp 0.3% 19-25.06.24	400.000	EUR	399.684	381.948	0,25
				<b>5.200.968</b>	<b>5.013.771</b>	<b>3,33</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	300.000	EUR	297.768	277.071	0,18
XS1883355197	Abbott Il F 1.5% 18-27.9.26 Regs	300.000	EUR	303.246	302.550	0,20
XS2013626010	Zurich Fina 1.625% 19-17.06.39	500.000	EUR	537.245	455.125	0,31
				<b>1.138.259</b>	<b>1.034.746</b>	<b>0,69</b>
<b>Italie</b>						
US465410BY32	Italy 2.875% 19-17.10.29	1.000.000	USD	857.625	873.930	0,58
IT0004644735	Italy 4.5% 10-01.03.26 Btp	500.000	EUR	573.960	597.935	0,40
US465410AH18	Italy 6.875% 93-27.09.23	2.000.000	USD	1.579.411	2.097.936	1,40
				<b>3.010.996</b>	<b>3.569.801</b>	<b>2,38</b>
<b>Japon</b>						
XS0159205995	Dbj 1.7% 02-20.09.22	90.000.000	JPY	526.071	791.756	0,53
XS1758752635	Mit Ufj 0.68% 18-26.01.23 Regs	1.000.000	EUR	1.001.330	970.020	0,64



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS2004880832	Mizu Fin 0.523% 19-10.06.24	1.000.000	EUR	1.007.072	945.060	0,63
				<b>2.534.473</b>	<b>2.706.836</b>	<b>1,80</b>
<b>Canada</b>						
XS2049707180	Bk N Scot 0.125% 19-4.9.26	500.000	EUR	495.025	446.730	0,30
XS2025468542	Cibc 0.04% 19-09.07.27	600.000	EUR	599.952	589.272	0,39
XS1945965611	Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	250.000	EUR	249.285	265.195	0,18
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	100.000	USD	89.782	79.532	0,05
CA74814ZFF59	Quebec Prov 2.3% 19-01.09.29	1.000.000	CAD	689.880	666.801	0,44
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	1.000.000	USD	908.235	930.891	0,62
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	1.000.000	EUR	1.003.516	940.649	0,63
				<b>4.035.675</b>	<b>3.919.070</b>	<b>2,61</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS1964701822	Aroundtown 5.375% 19-21.03.29	800.000	USD	702.127	814.195	0,54
XS0241594778	Bei 1.9% 06-26.01.26	25.000.000	JPY	203.169	238.104	0,16
XS0219724878	Bei 4% 05-15.10.37	700.000	EUR	915.621	1.149.449	0,77
US298785DV50	Bei 4.875% 06-15.02.36	600.000	USD	523.169	818.100	0,54
XS2050404800	Dh Eur 0.45% 19-18.03.28	250.000	EUR	249.378	224.195	0,15
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	400.000	EUR	396.508	367.264	0,24
				<b>2.989.972</b>	<b>3.611.307</b>	<b>2,40</b>
<b>Mexique</b>						
US191241AH15	Coca Co F 2.75% 20-22.01.30	150.000	USD	133.511	133.388	0,09
				<b>133.511</b>	<b>133.388</b>	<b>0,09</b>
<b>Pays-Bas</b>						
DE000A28RSR6	Allianz Fin 0.50% 20-14.01.31 Regs	400.000	EUR	397.064	366.564	0,24
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	400.000	EUR	400.000	404.000	0,27
XS1771838494	Ing Groep 1.125% 18-14.02.25	500.000	EUR	496.150	480.575	0,32
XS1882544973	Ing Groep 2% 18-20.09.28	500.000	EUR	569.750	491.560	0,33
XS2056374353	Mondelez In 0.875% 19-1.10.31	750.000	EUR	739.118	700.493	0,47
XS0228265574	Rabobk 4.55% 05-30.8.29 1434a	100.000	GBP	132.229	133.286	0,09
XS2049616621	Siemens Fin 0.125% 19-5.9.29	300.000	EUR	298.395	272.376	0,18
				<b>3.032.706</b>	<b>2.848.854</b>	<b>1,90</b>
<b>Autriche</b>						
CH0020632144	Oekb 2.875% 05-25.02.30	200.000	CHF	197.093	241.371	0,16
				<b>197.093</b>	<b>241.371</b>	<b>0,16</b>
<b>Philippines</b>						
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	110.000.000	JPY	949.267	1.105.334	0,74
				<b>949.267</b>	<b>1.105.334</b>	<b>0,74</b>
<b>Pologne</b>						
XS1958534528	Poland 1% 19-07.03.29 Regs	1.250.000	EUR	1.243.275	1.326.600	0,88
				<b>1.243.275</b>	<b>1.326.600</b>	<b>0,88</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Portugal</b>						
PTEDPKOM0034	Edp 4.496% 19-30.04.79	100.000	EUR	100.000	103.480	0,07
				<b>100.000</b>	<b>103.480</b>	<b>0,07</b>
<b>Roumanie</b>						
XS2027596530	Romania 2.124% 19-16.7.31 Regs	1.000.000	EUR	1.031.800	918.860	0,61
				<b>1.031.800</b>	<b>918.860</b>	<b>0,61</b>
<b>Espagne</b>						
ES0200002055	Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	400.000	EUR	399.012	387.288	0,26
XS2013745703	Bbva 1% 19-21.06.26	1.000.000	EUR	1.032.993	925.280	0,62
XS2076079594	Bco Sab 0.625% 19-07.11.25	500.000	EUR	495.625	463.635	0,31
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	400.000	EUR	398.344	381.268	0,25
XS1201001572	Santander I 2.5% 15-18.03.25	700.000	EUR	765.203	678.342	0,45
ES00000128Q6	Spain 2.35% 17-30.07.33 Regs	1.500.000	EUR	1.847.549	1.774.050	1,18
				<b>4.938.726</b>	<b>4.609.863</b>	<b>3,07</b>
<b>Corée du Sud</b>						
XS1999730374	Kr Hous Fin 0.10% 19-18.06.24	325.000	EUR	324.886	326.355	0,22
				<b>324.886</b>	<b>326.355</b>	<b>0,22</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	200.000	USD	178.638	200.866	0,13
XS0252367775	Amer Intl Grp 5% 06-26.4.23	300.000	GBP	376.183	367.022	0,24
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	400.000	EUR	396.992	374.012	0,25
US037833DN70	Apple Inc 2.05% 19-11.09.26	400.000	USD	361.539	374.711	0,25
XS1901137361	Celanese Us 2.125% 18-01.03.27	1.000.000	EUR	980.331	984.690	0,66
XS0168658853	Citigrp 5.15% 03-21.05.26	600.000	GBP	847.404	756.920	0,50
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	250.000	USD	223.907	215.865	0,14
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	300.000	EUR	299.877	286.758	0,19
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	200.000	USD	179.926	162.439	0,11
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	1.000.000	USD	665.454	1.335.657	0,89
XS0095130943	Ibrd 4.88% 99-7.12.28	1.150.000	GBP	1.760.022	1.748.779	1,16
US58013MEH34	Mc Donald S 5.7% 09-1.2.39	600.000	USD	480.526	685.993	0,46
US58013MFM10	McDonalds 2.125% 20-01.03.30	200.000	USD	178.826	169.493	0,11
US61747YDU64	Mor St 4.1%13-22.5.23	500.000	USD	477.295	469.774	0,31
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	600.000	EUR	598.480	503.724	0,34
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	500.000	USD	461.579	478.000	0,32
US9128283R96	Usa 0.5% 18-15.01.28 /infl	2.500.000	USD	1.984.190	2.493.018	1,66
				<b>10.451.169</b>	<b>11.607.721</b>	<b>7,72</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>52.483.249</b>	<b>54.111.038</b>	<b>36,01</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	2.148	EUR	238.872	110.300	0,07
FR0010040865	Gecina /act.nom.	503	EUR	76.194	60.712	0,04

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000121964	Klepierre	3.253	EUR	105.687	57.155	0,04
				<b>420.753</b>	<b>228.167</b>	<b>0,15</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	5.853	GBP	38.347	36.828	0,02
				<b>38.347</b>	<b>36.828</b>	<b>0,02</b>
	<b>Canada</b>					
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	22.425	CAD	122.187	128.223	0,09
				<b>122.187</b>	<b>128.223</b>	<b>0,09</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	2.289	USD	52.941	49.650	0,03
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	482	USD	56.574	45.259	0,03
US8666741041	Sun Communities Inc	638	USD	85.673	72.594	0,05
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	7.177	USD	161.624	108.841	0,08
US92936U1097	Wp Carey Inc Reit	657	USD	34.813	34.777	0,02
				<b>391.625</b>	<b>311.121</b>	<b>0,21</b>
	<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>			<b>972.912</b>	<b>704.339</b>	<b>0,47</b>
	<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>			<b>108.813.889</b>	<b>104.183.548</b>	<b>69,34</b>
	<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>					
	<b>Obligations</b>					
	<b>Canada</b>					
CA06367X7W56	Bmo 2.27% 17-11.07.22	1.000.000	CAD	687.230	641.125	0,43
CA68333ZAE75	Ontario 2.7% 18-02.06.29	1.000.000	CAD	710.878	686.324	0,45
				<b>1.398.108</b>	<b>1.327.449</b>	<b>0,88</b>
	<b>Total - Obligations</b>			<b>1.398.108</b>	<b>1.327.449</b>	<b>0,88</b>
	<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>			<b>1.398.108</b>	<b>1.327.449</b>	<b>0,88</b>
	<b>Parts de fonds</b>					
	<b>Fonds de placement</b>					
	<b>Irlande</b>					
IE00B6TLWG59	Gam Star Cat Bd Inst Cl Eur	413.624	EUR	5.323.419	5.558.278	3,70
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	243.261	USD	1.470.378	1.473.201	0,98
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	103.733	USD	4.643.731	4.486.825	2,99
				<b>11.437.528</b>	<b>11.518.304</b>	<b>7,67</b>
	<b>Luxembourg</b>					
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	43.147	USD	4.313.128	4.415.170	2,94
LU1637934156	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Eur	86.462	EUR	8.379.081	8.269.273	5,50

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	37.002	USD	3.673.144	3.026.256	2,01
				<b>16.365.353</b>	<b>15.710.699</b>	<b>10,45</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>27.802.881</b>	<b>27.229.003</b>	<b>18,12</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>27.802.881</b>	<b>27.229.003</b>	<b>18,12</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>138.014.878</b>	<b>132.740.000</b>	<b>88,34</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

Répartition géographique	%	Répartition économique	%
Etats-Unis d'Amérique	13,63	Fonds d'investissements	18,21
Luxembourg	12,87	Banques et autres institutions financières	11,64
Irlande	9,05	Obligations d'Etats et de villes étrangers	9,99
France	8,29	Holdings et sociétés financières	7,57
Allemagne	5,43	Pharmacie et cosmétique	5,13
Canada	5,25	Supranational	4,87
Japon	5,03	Electrotechnique, électronique	3,32
Royaume-Uni	4,94	Alimentation, boissons	2,55
Espagne	4,45	Assurances	2,48
Pays-Bas	4,42	Internet Software	1,93
Suisse	4,01	Commerce de détail et grands magasins	1,72
Italie	3,37	Chimie	1,72
Belgique	2,01	Transmission de nouvelles	1,72
Pologne	0,88	Energie et service des eaux	1,71
Australie	0,81	Pétrole	1,56
Philippines	0,74	Circulation et transport	1,41
Roumanie	0,61	Sociétés immobilières	1,39
Finlande	0,48	Construction, matériel de construction	1,41
Caïmans (Iles)	0,47	Arts graphiques et maisons d'édition	1,16
Chine	0,39	Articles de bureau et ordinateurs	1,08
Autriche	0,22	Mécanique, outillage	0,84
Corée du Sud	0,22	Biens de consommation divers	0,72
Côte d'Ivoire	0,22	Textile et habillement	0,65
Portugal	0,18	Gastronomie	0,64
Chili	0,11	Véhicules routiers	0,58
Mexique	0,09	Santé, éducation et services sociaux	0,54
Jersey	0,08	Services divers	0,48
Bermudes	0,07	Caoutchouc et pneus	0,30
Liechtenstein	0,02	Papier et bois	0,22
	<b>88,34</b>	Métaux non ferreux	0,21
		Biotechnologie	0,17
		Industrie aéronautique et spatiale	0,14
		Mines, aciéries	0,06
		Maisons de commerce diverses	0,06
		Photographie et optique	0,06
		Service d'environnement et de recyclage	0,04
		Agriculture et pêche	0,02
		Métaux et pierres précieuses	0,02
		Industrie horlogère	0,02
			<b>88,34</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Bermudes</b>						
BMG0450A1053	Arch Capital Gp Ltd Bermuda	69	USD	1.775	1.964	0,01
BMG0750C1082	Axalta Coating Systems Ltd	571	USD	16.933	9.861	0,07
BMG169621056	Bunge Ltd	65	USD	2.381	2.667	0,02
BMG3223R1088	Everest Reinsurance Group Ltd	15	USD	2.623	2.886	0,02
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	231	USD	18.584	13.860	0,10
BMG7496G1033	Renaissancere Hld Ltd	71	USD	13.973	10.602	0,07
				<b>56.269</b>	<b>41.840</b>	<b>0,29</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	570	USD	19.286	7.689	0,05
				<b>19.286</b>	<b>7.689</b>	<b>0,05</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB0006731235	Associated British Foods Plc	521	GBP	17.889	11.719	0,08
GB0009895292	Astrazeneca Plc	59	GBP	4.825	5.279	0,04
GB0031348658	Barclays Plc	7.836	GBP	9.798	9.144	0,06
GB0007980591	Bp Plc	5.550	GBP	22.266	23.687	0,17
GB0031743007	Burberry Group Plc	217	GBP	3.474	3.564	0,03
GB00B033F229	Centrica Plc	16.638	GBP	19.850	7.856	0,06
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	1.217	GBP	25.996	22.856	0,16
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	1.095	GBP	6.600	6.168	0,04
GB00B0SWJX34	Lse Group	39	GBP	3.397	3.520	0,02
GB0031274896	Marks And Spencer /new	3.038	GBP	7.276	3.738	0,03
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	591	GBP	6.099	2.931	0,02
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	42	GBP	2.855	3.203	0,02
GB00B2B0DG97	Relx Plc	775	GBP	18.859	16.644	0,12
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	287	GBP	12.959	13.233	0,09
GB00BKMKR23	Rsa Insurance Group Plc	794	GBP	3.983	4.139	0,03
GB00B8C3BL03	Sage Grp	309	GBP	2.146	2.267	0,02
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	205	GBP	3.429	3.646	0,03
GB0004082847	Standard Chartered Plc	1.448	GBP	8.103	8.004	0,06
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	7.194	GBP	14.696	10.481	0,07
GB0008847096	Tesco Plc	745	GBP	1.951	2.114	0,01
GB00B10RZP78	Unilever Plc	342	GBP	19.855	17.283	0,12
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	10.516	GBP	21.101	14.734	0,10
				<b>237.407</b>	<b>196.210</b>	<b>1,38</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	122	USD	20.127	19.918	0,14
IE00BY9D5467	Allergan Plc	34	USD	5.747	6.021	0,04
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	149	USD	15.662	11.576	0,08
IE00B4Q5ZN47	Jazz Pharmaceuticals Plc	24	USD	3.252	2.394	0,02
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	337	USD	13.124	9.086	0,06

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IE00BZ12WP82	Linde Plc	15	USD	2.480	2.595	0,02
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	249	USD	23.041	22.454	0,16
IE00BLS09M33	Pentair Plc	82	USD	2.379	2.440	0,02
				<b>85.812</b>	<b>76.484</b>	<b>0,54</b>
<b>Jersey</b>						
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	219	GBP	19.177	13.730	0,10
				<b>19.177</b>	<b>13.730</b>	<b>0,10</b>
<b>Canada</b>						
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	334	CAD	12.779	3.696	0,03
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	221	CAD	5.196	5.147	0,04
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	260	CAD	8.957	7.119	0,05
CA05534B7604	Bce Inc	309	CAD	14.955	12.533	0,09
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	1.110	CAD	32.500	15.012	0,11
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	531	CAD	15.865	12.550	0,09
CA15135U1093	Cenovus Energy	1.636	CAD	16.253	3.264	0,02
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	170	CAD	8.351	9.100	0,06
CA2908761018	Emera Inc	66	CAD	2.326	2.574	0,02
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	557	CAD	12.126	10.773	0,08
CA9611485090	George Weston Ltd	120	CAD	7.947	8.484	0,06
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	108	CAD	4.523	3.357	0,02
CA45823T1066	Intact Fin	140	CAD	11.638	11.963	0,08
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	152	CAD	4.940	4.426	0,03
CA5592224011	Magna International Inc	96	CAD	2.918	3.029	0,02
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	1.397	CAD	25.275	17.343	0,12
CA67077M1086	Nutrien Ltd	119	CAD	3.622	4.022	0,03
CA6837151068	Open Text Corp	191	CAD	6.175	6.604	0,05
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	746	CAD	27.687	13.003	0,09
CA7392391016	Power Corp.canada	1.003	CAD	22.738	15.954	0,11
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	161	CAD	7.017	6.415	0,05
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	119	CAD	7.067	7.288	0,05
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	583	CAD	28.928	18.542	0,13
CA8672241079	Suncor Energy	675	CAD	21.967	10.651	0,07
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	114	CAD	4.740	4.792	0,03
CA94106B1013	Waste Connections Inc	37	USD	2.645	2.868	0,02
CA92938W2022	Wsp Global Inc	162	CAD	9.374	9.096	0,06
				<b>328.509</b>	<b>229.605</b>	<b>1,61</b>
<b>Suisse</b>						
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	39	CHF	71.093	78.197	0,55
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	7.268	CHF	103.034	60.094	0,42
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	53	CHF	54.267	36.646	0,26
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	44	CHF	65.960	53.252	0,37
CH0114405324	Garmin	152	USD	15.173	11.394	0,08
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	2.147	CHF	106.861	78.464	0,55
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	1.076	CHF	86.909	88.800	0,62
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	463	CHF	113.779	150.283	1,06
CH0126881561	Swiss Re-namen	1.024	CHF	94.767	78.910	0,55



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0008742519	Swisscom /nam.	161	CHF	74.468	86.561	0,61
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	296	CHF	90.663	105.055	0,74
				<b>876.974</b>	<b>827.656</b>	<b>5,81</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	97	USD	6.864	7.654	0,05
US00287Y1091	Abbvie Inc	263	USD	23.051	20.038	0,14
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	103	USD	5.446	6.126	0,04
US00724F1012	Adobe Inc	21	USD	6.425	6.683	0,05
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc	92	USD	4.107	4.184	0,03
US00130H1059	Aes Corp.	711	USD	13.454	9.670	0,07
US0010551028	Aflac Inc.	181	USD	6.649	6.197	0,04
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	82	USD	7.858	7.502	0,05
US0171751003	Alleghany Corp (del)	6	USD	4.812	3.314	0,02
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	27	USD	29.748	31.372	0,22
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	40	USD	51.779	46.511	0,33
US0231351067	Amazon Com Inc	42	USD	76.107	81.887	0,58
US0258161092	American Express Co.	194	USD	20.015	16.608	0,12
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	53	USD	7.657	5.431	0,04
US0311621009	Amgen Inc	89	USD	17.869	18.043	0,13
US0367521038	Anthem Inc	12	USD	2.597	2.724	0,02
US0378331005	Apple Inc	453	USD	93.546	115.192	0,80
US0382221051	Applied Materials Inc	268	USD	16.295	12.280	0,09
US0394831020	Archer-daniels Midland Co	114	USD	3.728	4.011	0,03
US03965L1008	Arconic Inc	482	USD	11.959	7.741	0,05
US04621X1081	Assurant Inc	101	USD	12.660	10.513	0,07
US00206R1023	At & T	1.024	USD	32.247	29.850	0,21
US0605051046	Bank Of America Corp	746	USD	17.415	15.838	0,11
US0865161014	Best Buy Co Inc.	80	USD	5.768	4.560	0,03
US09062X1037	Biogen Inc	20	USD	5.700	6.328	0,04
US09247X1019	Blackrock Inc	38	USD	20.333	16.719	0,12
US1011371077	Boston Scientific Corp.	242	USD	7.242	7.896	0,06
US11133T1034	Brdrdg Fncl Solutions /wh.iss.	18	USD	1.691	1.707	0,01
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	380	USD	20.785	21.181	0,15
US1273871087	Cadence Design Systems	36	USD	2.209	2.377	0,02
US1491231015	Caterpillar Inc.	26	USD	2.722	3.017	0,02
US12508E1010	Cdk Global Inc	81	USD	2.767	2.661	0,02
US1567001060	Centurylink Inc	171	USD	1.548	1.618	0,01
US1567821046	Cerner Corp	192	USD	13.601	12.094	0,08
US1667641005	Chevron Corporation	223	USD	15.450	16.159	0,11
US1255231003	Cigna Corporation	21	USD	3.294	3.721	0,03
US1729081059	Cintas	34	USD	8.867	5.889	0,04
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	416	USD	15.673	16.353	0,11
US1729674242	Citigroup Inc	452	USD	28.980	19.038	0,13
US1890541097	Clorox Co *opa*	32	USD	5.302	5.544	0,04
US1912161007	Coca-cola Co.	622	USD	37.151	27.524	0,19
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	125	USD	7.487	8.295	0,06
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	332	USD	11.147	11.414	0,08
US20825C1045	Conocophillips	449	USD	29.345	13.829	0,10
US22160K1051	Costco Wholesale Corp	28	USD	7.865	7.984	0,06



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US2283681060	Crown Holdings Inc	70	USD	3.785	4.063	0,03
US2310211063	Cummins Inc	54	USD	6.901	7.307	0,05
US1266501006	Cvs Health Corp	139	USD	10.229	8.247	0,06
US2521311074	Dexcom Inc	10	USD	2.394	2.693	0,02
US25470F3029	Discovery Com Inc / -c-	144	USD	2.710	2.526	0,02
US25746U1097	Dominion Energy Inc	227	USD	20.263	16.387	0,12
US2600031080	Dover Corp.	149	USD	13.738	12.507	0,09
US26441C2044	Duke Energy	145	USD	10.835	11.728	0,08
US2774321002	Eastman Chemical Co	144	USD	6.709	6.708	0,05
US2786421030	Ebay Inc	78	USD	2.213	2.345	0,02
US2788651006	Ecolab Inc.	24	USD	3.643	3.740	0,03
US28176E1082	Edwards Lifesciences	22	USD	4.201	4.150	0,03
US2855121099	Electronic Arts	74	USD	8.082	7.413	0,05
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	779	USD	17.305	11.257	0,08
US30231G1022	Exxon Mobil Corp	189	USD	7.049	7.176	0,05
US30303M1027	Facebook Inc -a-	256	USD	46.236	42.700	0,30
US3167731005	Fifth Third Bancorp	608	USD	9.012	9.029	0,06
US34354P1057	Flowserve Corp	95	USD	2.185	2.270	0,02
US35137L1052	Fox --- Registered Shs -a-	107	USD	2.583	2.528	0,02
US3156161024	F5 Networks Inc.	92	USD	12.218	9.810	0,07
US3696041033	General Electric Co	899	USD	6.797	7.138	0,05
US3703341046	General Mills Inc	52	USD	2.478	2.744	0,02
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	111	USD	7.733	8.298	0,06
US37959E1029	Globe Life Inc	162	USD	15.341	11.659	0,08
US3802371076	Godaddy Inc	35	USD	2.012	1.999	0,01
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	85	USD	19.785	13.140	0,09
US42824C1099	Hewlett Packard Ent Co	224	USD	2.104	2.175	0,02
US4361061082	Hollyfrontier Corp	213	USD	11.036	5.221	0,04
US4364401012	Hologic Inc	110	USD	3.549	3.861	0,03
US4370761029	Home Depot Inc.	91	USD	17.367	16.991	0,12
US40434L1052	Hp Inc	115	USD	1.769	1.996	0,01
US4448591028	Humana Inc.	11	USD	2.960	3.454	0,02
US4592001014	Ibm Corp	133	USD	14.080	14.754	0,10
US4581401001	Intel Corp.	486	USD	28.101	26.302	0,18
US45866F1049	Intercont Exch	52	USD	3.876	4.199	0,03
US4612021034	Intuit	47	USD	10.933	10.810	0,08
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	13	USD	5.985	6.438	0,05
US47233W1099	Jefferies Financial Group Inc	528	USD	12.526	7.218	0,05
US4781601046	Johnson & Johnson	329	USD	44.566	43.141	0,30
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	22	USD	2.007	2.222	0,02
US48203R1041	Juniper Networks Inc.	164	USD	3.185	3.139	0,02
US4851703029	Kansas City Southern	35	USD	4.621	4.451	0,03
US4878361082	Kellogg Co	89	USD	6.297	5.339	0,04
US4943681035	Kimberly Clark Corp	111	USD	15.013	14.194	0,10
US5010441013	Kroger Co.	153	USD	4.275	4.608	0,03
US5128071082	Lam Research Corp	53	USD	12.552	12.720	0,09
US5312296073	Liberty Media Corp	211	USD	8.814	6.672	0,05
US5324571083	Lilly (eli) & Co	144	USD	20.451	19.976	0,14
US5018892084	Lkq	190	USD	3.801	3.897	0,03
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	153	USD	18.251	13.166	0,09

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US5500211090	Lululemon Athletica Inc	28	USD	7.384	5.307	0,04
US56585A1025	Marathon Petroleum Corp	99	USD	2.090	2.338	0,02
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	129	USD	32.585	31.161	0,22
US58155Q1031	Mckesson Corp	33	USD	4.848	4.464	0,03
US58933Y1055	Merck	375	USD	25.907	28.853	0,20
US59156R1086	Metlife Inc	451	USD	20.254	13.787	0,10
US5951121038	Micron Technology Inc	84	USD	3.571	3.533	0,02
US5949181045	Microsoft Corp.	752	USD	85.275	118.597	0,82
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	254	USD	11.714	12.720	0,09
US61174X1090	Monster Beverage Corp	212	USD	14.927	11.927	0,08
US6153691059	Moody S Corp	70	USD	17.532	14.805	0,10
US6174464486	Morgan Stanley	118	USD	4.011	4.012	0,03
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	42	USD	5.615	5.583	0,04
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	276	USD	13.278	12.497	0,09
US6541061031	Nike Inc B	215	USD	16.990	17.789	0,12
US65473P1057	Nisource Inc	296	USD	6.759	7.391	0,05
US6687711084	Nortonlifelock Rg	120	USD	2.147	2.245	0,02
US6293775085	Nrg Energy Inc	208	USD	8.155	5.670	0,04
US67066G1040	Nvidia Corp.	66	USD	16.213	17.398	0,12
US6907421019	Owens Corning Inc	208	USD	12.812	8.072	0,06
US6974351057	Palo Alto Networks Inc	10	USD	1.660	1.640	0,01
US7010941042	Parker-hannifin	74	USD	9.365	9.600	0,07
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	97	USD	9.285	9.287	0,07
US7134481081	Pepsico Inc	216	USD	29.418	25.942	0,18
US7170811035	Pfizer Inc.	441	USD	13.122	14.394	0,10
US7185461040	Phillips 66	40	USD	2.020	2.146	0,02
US6934751057	Pnc Financial Services Gp	24	USD	2.210	2.297	0,02
US6935061076	Ppg Industries Inc.	145	USD	18.867	12.122	0,09
US69351T1060	Ppl Corp	438	USD	9.738	10.810	0,08
US7458671010	Pultegroup Inc	635	USD	24.425	14.173	0,10
US74736K1016	Qorvo Inc	56	USD	6.298	4.515	0,03
US7475251036	Qualcomm Inc.	212	USD	18.778	14.342	0,10
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	105	USD	10.784	8.432	0,06
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	10	USD	4.298	4.883	0,03
US7591EP1005	Regions Financial Corp	1.239	USD	20.560	11.114	0,08
US7607591002	Republic Services Inc.	155	USD	11.659	11.634	0,08
US79466L3024	Salesforce Com Inc	63	USD	9.266	9.071	0,06
US7841171033	Sei Investments Co	196	USD	12.310	9.083	0,06
US8243481061	Sherwin-williams Co	22	USD	12.852	10.109	0,07
US82968B1035	Sirius Xm Holdings Inc	2.107	USD	14.285	10.409	0,07
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc	45	USD	5.540	4.022	0,03
US8330341012	Snap-on Inc	40	USD	6.302	4.353	0,03
US78409V1044	S&p Global Shs	69	USD	17.943	16.908	0,12
US8545021011	Stanley Black & Decker Inc	29	USD	2.850	2.900	0,02
US87165B1035	Synchrony Financial	255	USD	4.249	4.103	0,03
US8716071076	Synopsys Inc.	58	USD	7.038	7.470	0,05
US8718291078	Sysco Corp.	204	USD	14.666	9.309	0,07
US74144T1088	T Rowe Price Group Inc.	92	USD	12.148	8.984	0,06
US87612E1064	Target Corp	116	USD	9.396	10.785	0,08
US4278661081	The Hershey Co	19	USD	2.397	2.518	0,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US8725401090	Tjx Companies Inc	349	USD	18.647	16.686	0,12
US89400J1079	Transunion	55	USD	3.618	3.640	0,03
US9078181081	Union Pacific Corp.	77	USD	10.236	10.860	0,08
US9113631090	United Rentals Inc.	41	USD	6.018	4.219	0,03
US9130171096	United Technologies Corp	196	USD	18.856	18.489	0,13
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	93	USD	22.889	23.192	0,16
US91529Y1064	Unum Group	177	USD	5.233	2.657	0,02
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc	29	USD	3.041	2.977	0,02
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	26	USD	5.463	6.187	0,04
US92826C8394	Visa Inc -a	228	USD	36.507	36.734	0,26
US9285634021	Vmware Inc	26	USD	3.022	3.149	0,02
US9290891004	Voya Financial	89	USD	3.394	3.609	0,03
US9297401088	Wabtec Corp	59	USD	2.756	2.840	0,02
US9314271084	Walgreens Boots Alliance Inc	34	USD	1.409	1.556	0,01
US2546871060	Walt Disney	106	USD	10.679	10.240	0,07
US96145D1054	Westrock Co	166	USD	7.212	4.691	0,03
US9633201069	Whirlpool Corp.	67	USD	9.702	5.749	0,04
US3848021040	Ww Grainger Inc	20	USD	6.631	4.970	0,03
US9884981013	Yum Brands Shs	96	USD	6.997	6.579	0,05
US88579Y1010	3m Co	18	USD	2.368	2.457	0,02
				<b>2.052.245</b>	<b>1.908.768</b>	<b>13,42</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>3.675.679</b>	<b>3.301.982</b>	<b>23,20</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
US2027A1JT52	Cw Bk Austr 3.15% 17-19.09.27	200.000	USD	203.382	207.350	1,45
AU3CB0260990	Nat Aus Bk 2.9% 19-26.02.24	250.000	AUD	180.699	160.472	1,13
				<b>384.081</b>	<b>367.822</b>	<b>2,58</b>
<b>Belgique</b>						
BE0000320292	Belgium 4.25% 10-28.3.41 Olo	150.000	EUR	289.702	281.981	1,98
				<b>289.702</b>	<b>281.981</b>	<b>1,98</b>
<b>Caïmans (Iles)</b>						
US88032XAD66	Tencent Hol 3.8% 15-11.02.25	200.000	USD	196.222	213.900	1,50
				<b>196.222</b>	<b>213.900</b>	<b>1,50</b>
<b>Chili</b>						
US05968AAG13	Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	200.000	USD	200.000	187.616	1,32
				<b>200.000</b>	<b>187.616</b>	<b>1,32</b>
<b>Chine</b>						
US04522KAA43	Asian Infra 2.25% 19-16.05.24	100.000	USD	99.718	106.698	0,75
				<b>99.718</b>	<b>106.698</b>	<b>0,75</b>
<b>Allemagne</b>						
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	100.000	USD	99.900	106.621	0,75

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US500769HS68	Kfw 2.875% 18-03.04.28	200.000	USD	197.729	230.834	1,62
US515110BN30	Lwf Rentbk 2% 15-13.01.25	100.000	USD	94.100	106.428	0,75
				<b>391.729</b>	<b>443.883</b>	<b>3,12</b>
<b>France</b>						
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	150.000	EUR	217.728	219.999	1,55
				<b>217.728</b>	<b>219.999</b>	<b>1,55</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS1550975079	Barclays 3.125% 17-17.01.24	100.000	GBP	133.096	121.175	0,85
XS1823595647	Hsbc Hldg 2.175% 18-27.06.23	200.000	GBP	264.493	243.668	1,72
XS1788982996	Lloyds Bk 1.75% 18-07.09.28	150.000	EUR	166.457	154.309	1,08
US53944VAH24	Lloyds 3.5% 15-14.05.25	200.000	USD	196.268	195.080	1,37
				<b>760.314</b>	<b>714.232</b>	<b>5,02</b>
<b>Japon</b>						
US606822AU87	Mit Ufj Fin 3.777% 18-02.03.25	100.000	USD	101.263	104.965	0,74
				<b>101.263</b>	<b>104.965</b>	<b>0,74</b>
<b>Canada</b>						
US064159MK98	Bk N Scotia 3.4% 19-11.02.24	200.000	USD	203.050	209.016	1,47
US68323ACT97	Ontario 3.2% 14-16.05.24	100.000	USD	99.784	109.320	0,77
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	100.000	USD	99.868	102.142	0,72
US89114QCB23	Tor Dom Bk 3.25% 19-11.03.24	300.000	USD	309.060	313.539	2,20
				<b>711.762</b>	<b>734.017</b>	<b>5,16</b>
<b>Pays-Bas</b>						
US21685WDD65	Rabobk 3.875% 12-08.02.22	100.000	USD	101.518	102.872	0,72
				<b>101.518</b>	<b>102.872</b>	<b>0,72</b>
<b>Espagne</b>						
US87938WAT09	Telefonica 4.103% 17-08.03.27	100.000	USD	98.000	102.967	0,72
				<b>98.000</b>	<b>102.967</b>	<b>0,72</b>
<b>Corée du Sud</b>						
US50064FAR55	Korea 2% 19-19.06.24	200.000	USD	198.332	207.844	1,46
				<b>198.332</b>	<b>207.844</b>	<b>1,46</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US026874DH71	Aig 3.9% 16-01.04.26	100.000	USD	97.042	104.112	0,73
US031162CP32	Amgen 2.65% 17-11.05.22	100.000	USD	97.160	100.971	0,71
US06051GHV41	Bac 3.194% 19-23.07.30	100.000	USD	104.105	102.563	0,72
US06051GHD43	Boa 3.419% 17-20.12.28	200.000	USD	191.122	206.496	1,45
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	100.000	USD	99.782	94.743	0,67
US38141IGGS75	Gs 5.75% 12-24.01.22	100.000	USD	107.010	106.237	0,75
US458182CZ31	Iadb 4.4% 06-26.01.26	200.000	CAD	169.348	166.169	1,17
US459058GE72	Ibrd 2.5% 17-22.11.27	200.000	USD	191.737	223.886	1,56
US46647PAM86	Jpm 3.509% 18-23.01.29	100.000	USD	95.548	104.759	0,74

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US58013MEY66	Mcdonalds 3.7% 15-30.01.26	100.000	USD	99.973	105.653	0,74
US58933YAR62	Merck 2.75% 15-10.02.25	100.000	USD	96.147	106.056	0,75
US594918BY93	Micro Corp 3.3% 17-06.02.27	100.000	USD	99.413	110.960	0,78
US61761J3R84	Mor St 3.125% 16-27.07.26	100.000	USD	93.704	103.774	0,73
US9128283R96	Usa 0.5% 18-15.01.28 /infl	200.000	USD	199.226	218.837	1,53
				<b>1.741.317</b>	<b>1.855.216</b>	<b>13,03</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>5.491.686</b>	<b>5.644.012</b>	<b>39,65</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	292	GBP	2.072	2.016	0,01
				<b>2.072</b>	<b>2.016</b>	<b>0,01</b>
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	840	CAD	4.958	5.270	0,04
				<b>4.958</b>	<b>5.270</b>	<b>0,04</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US03027X1000	American Tower Corp	18	USD	3.587	3.920	0,03
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	799	USD	4.755	4.051	0,03
US1011211018	Boston Properties	22	USD	1.999	2.029	0,01
US22822V1017	Crown Castle International Shs	115	USD	16.570	16.605	0,13
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	480	USD	15.342	11.424	0,08
US6819361006	Omega Healthcare Investors	300	USD	13.367	7.962	0,06
US7561091049	Realty Income Corp	37	USD	2.017	1.845	0,01
US8666741041	Sun Communities Inc	82	USD	12.167	10.238	0,07
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	799	USD	20.929	13.295	0,09
US92936U1097	Wp Carey Inc Reit	61	USD	3.501	3.543	0,02
				<b>94.234</b>	<b>74.912</b>	<b>0,53</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>101.264</b>	<b>82.198</b>	<b>0,58</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>9.268.629</b>	<b>9.028.192</b>	<b>63,43</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
CA68333ZAA53	Ontario 2.9% 17-02.06.49	200.000	CAD	167.897	150.668	1,06
CA74814ZEW91	Quebec Prov 3.5% 15-01.12.48	100.000	CAD	93.889	84.061	0,59
				<b>261.786</b>	<b>234.729</b>	<b>1,65</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Pays-Bas</b>						
AU3CB0241933	Bng 3.5% 17-19.07.27	250.000	AUD	192.101	174.199	1,22
				<b>192.101</b>	<b>174.199</b>	<b>1,22</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>453.887</b>	<b>408.928</b>	<b>2,87</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>453.887</b>	<b>408.928</b>	<b>2,87</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00B3ZBQ888	Gam Star Cat Bd -inst- Usd	50.938	USD	557.319	545.073	3,83
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	21.644	USD	147.768	143.824	1,01
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	8.833	USD	442.419	419.214	2,95
				<b>1.147.506</b>	<b>1.108.111</b>	<b>7,79</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	5.419	USD	696.517	608.445	4,27
LU1637934230	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nt	7.406	USD	753.487	764.893	5,38
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	1.403	USD	145.182	125.905	0,88
LU1900092039	Swisscanto (lu) Equity Fund Systematic Responsible Eurozone Nt	4.418	EUR	495.108	408.269	2,87
LU1900092971	Swisscanto (lu) Equity Fund Systematic Responsible Japan Nt Chf	4.776	CHF	466.713	438.184	3,08
				<b>2.557.007</b>	<b>2.345.696</b>	<b>16,48</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>3.704.513</b>	<b>3.453.807</b>	<b>24,27</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>3.704.513</b>	<b>3.453.807</b>	<b>24,27</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>13.427.029</b>	<b>12.890.927</b>	<b>90,57</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Etats-Unis d'Amérique	26,98	Fonds d'investissements	24,31
Luxembourg	16,48	Banques et autres institutions financières	23,61
Canada	8,46	Obligations d'Etats et de villes étrangers	8,94
Irlande	8,33	Pharmacie et cosmétique	4,13
Royaume-Uni	6,41	Supranational	3,48
Suisse	5,81	Holdings et sociétés financières	3,08
Allemagne	3,12	Assurances	2,85
Australie	2,58	Internet Software	2,32
Belgique	1,98	Transmission de nouvelles	1,90
Pays-Bas	1,94	Commerce de détail et grands magasins	1,91
France	1,55	Arts graphiques et maisons d'édition	1,89
Caïmans (Iles)	1,50	Construction, matériel de construction	1,43
Corée du Sud	1,46	Alimentation, boissons	1,40
Chili	1,32	Energie et service des eaux	1,31
Chine	0,75	Articles de bureau et ordinateurs	1,04
Japon	0,74	Biotechnologie	1,01
Espagne	0,72	Pétrole	0,85
Bermudes	0,29	Gastronomie	0,79
Jersey	0,10	Mécanique, outillage	0,73
Curacao	0,05	Electrotechnique, électronique	0,69
	<b>90,57</b>	Services divers	0,54
		Sociétés immobilières	0,48
		Santé, éducation et services sociaux	0,31
		Biens de consommation divers	0,26
		Textile et habillement	0,23
		Chimie	0,17
		Industrie aéronautique et spatiale	0,16
		Métaux non ferreux	0,14
		Papier et bois	0,13
		Circulation et transport	0,11
		Service d'environnement et de recyclage	0,10
		Métaux et pierres précieuses	0,09
		Maisons de commerce diverses	0,07
		Véhicules routiers	0,05
		Mines, aciéries	0,03
		Agriculture et pêche	0,03
			<b>90,57</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0003826436	Telenet Group Holding	1.799	EUR	76.602	52.408	0,03
BE0003739530	Ucb	1.971	EUR	186.458	165.307	0,09
				<b>263.060</b>	<b>217.715</b>	<b>0,12</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG169621056	Bunge Ltd	691	USD	24.766	27.432	0,01
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	2.766	USD	218.614	160.574	0,09
				<b>243.380</b>	<b>188.006</b>	<b>0,10</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	1.875	USD	26.785	24.473	0,01
				<b>26.785</b>	<b>24.473</b>	<b>0,01</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	893	EUR	272.034	195.203	0,10
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	1.867	EUR	402.802	310.949	0,18
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	283	EUR	28.693	27.809	0,01
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	955	EUR	108.308	89.576	0,05
DE0005439004	Continental Ag	382	EUR	27.135	26.608	0,01
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	5.505	EUR	37.535	34.885	0,02
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	1.571	EUR	224.434	208.481	0,11
DE0005552004	Deutsche Post Ag	5.742	EUR	218.333	151.028	0,08
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	7.251	EUR	92.147	90.944	0,05
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-	6.652	EUR	187.566	134.674	0,07
DE0006048432	Henkel / Vorzug	1.284	EUR	97.550	99.783	0,05
DE0006048408	Henkel Ag & Co. Kгаа	1.046	EUR	69.624	74.791	0,04
DE000KGX8881	Kion Group	497	EUR	21.008	20.810	0,01
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	1.067	EUR	236.743	208.544	0,11
DE0007164600	Sap Se	2.141	EUR	224.657	233.662	0,12
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	1.957	EUR	220.697	160.955	0,09
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	50.816	EUR	202.245	121.870	0,07
DE000UNSE018	Uniper Se	3.752	EUR	107.825	89.584	0,05
				<b>2.779.336</b>	<b>2.280.156</b>	<b>1,22</b>
<b>Finlande</b>						
FI0009007132	Fortum Corporation	3.100	EUR	43.240	44.018	0,02
FI0009007835	Metso Corp	5.870	EUR	209.556	135.357	0,08
FI0009000681	Nokia Oy	15.074	EUR	45.439	45.913	0,02
				<b>298.235</b>	<b>225.288</b>	<b>0,12</b>
<b>France</b>						
FR0000120073	Air Liquide	2.239	EUR	283.473	277.280	0,15
FR0000120628	Axa	12.907	EUR	350.069	216.337	0,12



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000131104	Bnp Paribas	4.281	EUR	136.532	125.030	0,07
FR0000120644	Danone.	1.788	EUR	106.672	111.312	0,06
FR0000130452	Eiffage Sa	2.028	EUR	220.747	138.870	0,07
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	1.714	EUR	258.035	178.836	0,10
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	8.950	EUR	174.741	90.513	0,05
FR0000121485	Kering Sa	405	EUR	254.753	204.621	0,11
FR0000120321	L Oreal	541	EUR	157.287	137.212	0,07
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	936	EUR	57.374	58.112	0,03
FR0000121261	Michelin B /nom.	1.034	EUR	88.334	88.983	0,05
FR0000125007	Saint-gobain	7.137	EUR	296.544	167.943	0,09
FR0000120578	Sanofi	2.984	EUR	245.340	253.879	0,14
FR0000121972	Schneider Electric Se	2.973	EUR	325.708	248.020	0,13
FR0000130809	Ste Gen.paris -a-	1.203	EUR	22.127	19.602	0,01
FR0010613471	Suez Environnement Cie	11.973	EUR	173.388	117.908	0,06
FR0000120271	Total Sa	10.145	EUR	580.896	381.164	0,20
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	319	EUR	21.155	22.752	0,01
FR0000124141	Veolia Environnement	7.415	EUR	193.785	153.309	0,08
				<b>3.946.960</b>	<b>2.991.683</b>	<b>1,60</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
GB00B02J6398	Admiral Group Plc	2.405	GBP	63.003	64.342	0,03
GB0000456144	Antofagasta Plc	2.723	GBP	23.308	25.253	0,01
GB0000536739	Ashtead Group Plc	3.976	GBP	116.837	84.215	0,05
GB0006731235	Associated British Foods Plc	6.660	GBP	216.342	144.940	0,08
GB0009895292	Astrazeneca Plc	2.871	GBP	229.680	248.546	0,13
GB0031348658	Barclays Plc	78.288	GBP	95.766	88.391	0,05
GB0007980591	Bp Plc	93.444	GBP	410.900	385.868	0,20
GB0031743007	Burberry Group Plc	9.757	GBP	256.505	155.041	0,08
GB00B033F229	Centrica Plc	158.182	GBP	298.157	72.266	0,04
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	4.949	GBP	64.041	75.049	0,04
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	20.105	GBP	421.897	365.325	0,20
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	33.478	GBP	239.313	182.445	0,10
GB0008706128	Lloyds Banking Group Plc	84.851	GBP	36.040	32.575	0,02
GB00B0SWJX34	Lse Group	341	GBP	29.055	29.783	0,02
GB0031274896	Marks And Spencer /new	46.235	GBP	108.790	55.047	0,03
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	92.888	GBP	212.999	101.967	0,05
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	10.875	GBP	110.256	52.188	0,03
GB0032089863	Next Plc	973	GBP	74.311	47.533	0,03
GB0006825383	Persimmon Plc	3.565	GBP	138.170	81.968	0,04
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	1.538	GBP	102.267	113.477	0,06
GB00B2B0DG97	Relx Plc	11.801	GBP	297.365	245.214	0,13
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	6.096	GBP	269.289	271.951	0,15
GB00BKKMKR23	Rsa Insurance Group Plc	4.372	GBP	21.457	22.051	0,01
GB00B8C3BL03	Sage Grp	4.544	GBP	30.877	32.262	0,02
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	3.682	GBP	60.249	63.367	0,03
GB00B1WY2338	Smiths Group Plc	2.588	GBP	33.474	38.066	0,02
GB0004082847	Standard Chartered Plc	17.792	GBP	97.401	95.157	0,05
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	94.736	GBP	172.796	133.546	0,07
GB0008847096	Tesco Plc	28.368	GBP	72.663	77.869	0,04
GB00B10RZP78	Unilever Plc	5.357	GBP	320.789	261.927	0,14

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	160.024	GBP	302.417	216.941	0,12
				<b>4.926.414</b>	<b>3.864.570</b>	<b>2,07</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	1.287	USD	200.496	203.297	0,10
IE00BY9D5467	Allergan Plc	311	USD	51.426	53.291	0,03
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	2.144	USD	163.386	161.162	0,09
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	4.152	USD	164.682	108.306	0,06
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	2.068	USD	196.804	180.441	0,09
IE00BLS09M33	Pentair Plc	1.044	USD	29.634	30.061	0,02
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	5.436	EUR	192.467	148.433	0,08
				<b>998.895</b>	<b>884.991</b>	<b>0,47</b>
<b>Italie</b>						
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	2.948	EUR	58.247	38.840	0,02
IT0003128367	Enel	34.649	EUR	189.812	233.180	0,12
IT0003132476	Eni Spa Roma	19.461	EUR	337.800	190.491	0,10
NL0011585146	Ferrari N.v.	494	EUR	73.251	74.236	0,04
IT0003796171	Poste Italiane Spa	5.823	EUR	64.758	47.725	0,03
				<b>723.868</b>	<b>584.472</b>	<b>0,31</b>
<b>Japon</b>						
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	2.400	JPY	60.058	57.303	0,03
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	3.300	JPY	54.170	59.463	0,03
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	14.400	JPY	214.619	215.660	0,12
JP3220580009	Calbee Inc	800	JPY	19.422	20.944	0,01
JP3242800005	Canon Inc.	5.500	JPY	119.717	116.284	0,06
JP3566800003	Central Japan Railway Co	900	JPY	143.428	139.708	0,07
JP3511800009	Chiba Bank	29.900	JPY	163.889	126.754	0,07
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	7.450	JPY	188.830	153.640	0,08
JP3485800001	Daicel --- Shs	17.000	JPY	176.019	120.214	0,06
JP3551500006	Denso Corp	5.700	JPY	230.519	178.343	0,10
JP3160400002	Eisai Co.ltd	1.100	JPY	73.337	78.190	0,04
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	6.300	JPY	110.578	109.427	0,06
JP3802400006	Fanuc Corp --- Shs	300	JPY	40.473	39.404	0,02
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	200	JPY	88.577	79.211	0,04
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	4.700	JPY	144.467	103.161	0,06
JP3818000006	Fujitsu Ltd	1.500	JPY	130.778	131.144	0,07
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	3.400	JPY	34.720	33.215	0,02
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	1.500	JPY	88.929	107.282	0,06
JP3788600009	Hitachi Ltd	8.000	JPY	284.345	225.354	0,12
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	6.900	JPY	157.157	150.275	0,08
JP3845770001	Hoshizaki Corp	300	JPY	23.997	21.806	0,01
JP3837800006	Hoya Corp	800	JPY	63.072	65.964	0,04
JP3294460005	Inpex Corp	28.655	JPY	271.142	156.353	0,08
JP3143900003	Itochu Techno-solutions	3.633	JPY	95.744	100.450	0,05
JP3705200008	Japan Air Lines Co Jpy50	1.300	JPY	24.690	23.186	0,01
JP3386030005	Jfe Holdings Inc	3.800	JPY	28.227	23.943	0,01
JP3205800000	Kao Corp.	3.000	JPY	245.086	237.418	0,13

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3496400007	Kddi Corp.	6.000	JPY	170.797	171.543	0,09
JP3266400005	Kubota Corp	2.900	JPY	33.497	35.907	0,02
JP3982100004	Lawson Inc	2.400	JPY	130.943	127.555	0,07
JP3626800001	Lixil Group Shs	12.987	JPY	219.166	156.553	0,08
JP3750500005	Mcdonald S Holdings Co (japan)	400	JPY	17.561	17.459	0,01
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	9.900	JPY	147.340	141.523	0,08
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	26.392	JPY	158.511	125.839	0,07
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	2.700	JPY	45.873	45.264	0,02
JP3885780001	Mizuho Financial Groupinc	80.000	JPY	94.688	88.622	0,05
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	6.200	JPY	203.093	168.092	0,09
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	1.600	JPY	77.408	78.469	0,04
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	460	JPY	173.809	171.548	0,09
JP3743000006	Nippon Meat Packers	1.800	JPY	65.107	60.739	0,03
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co.ltd.	1.500	JPY	76.834	76.092	0,04
JP3735400008	Nippon Tel&tel	7.600	JPY	184.935	175.431	0,09
JP3672400003	Nissan Motor Co.ltd	10.800	JPY	38.036	34.517	0,02
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	4.200	JPY	64.757	67.832	0,04
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	3.600	JPY	203.885	155.679	0,08
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	8.900	JPY	201.249	139.990	0,07
JP3720800006	Nsk Ltd	3.200	JPY	20.904	19.904	0,01
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	7.998	JPY	208.303	242.071	0,13
JP3190000004	Obayashi Corp.	18.100	JPY	166.186	150.217	0,08
JP3201200007	Olympus Corp	10.600	JPY	126.327	148.394	0,08
JP3200450009	Orix Corp	9.200	JPY	129.002	107.233	0,06
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	1.200	JPY	41.619	45.505	0,02
JP3866800000	Panasonic Corp	6.200	JPY	45.886	45.843	0,02
JP3855900001	Pola Orbis Holdings Inc	1.300	JPY	23.571	23.244	0,01
JP3970300004	Recruit Holdings Co.ltd.	2.900	JPY	79.114	72.672	0,04
JP3336000009	Santen Pharmaceutical	2.100	JPY	35.425	34.970	0,02
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	5.600	JPY	96.449	71.923	0,04
JP3162770006	Sg Holdings Co. Ltd.	1.000	JPY	21.424	23.061	0,01
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	2.498	JPY	219.222	240.228	0,13
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	1.000	JPY	44.227	47.654	0,03
JP3732000009	Softbank Corp.	1.600	JPY	19.935	19.710	0,01
JP3435000009	Sony Corp	6.000	JPY	395.615	345.290	0,19
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	13.800	JPY	39.865	39.702	0,02
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	3.500	JPY	90.673	82.281	0,04
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	5.500	JPY	194.096	153.994	0,08
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	4.100	JPY	118.652	127.143	0,07
JP3336560002	Suntory B & F	3.700	JPY	132.874	135.464	0,07
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Tokyo	5.100	JPY	140.218	84.562	0,05
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	3.200	JPY	93.986	94.874	0,05
JP3544000007	Teijin Ltd	6.694	JPY	127.055	109.791	0,06
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	4.800	JPY	257.944	212.950	0,11
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	1.100	JPY	232.952	200.676	0,11
JP3629000005	Toppan Printing Co.ltd	4.486	JPY	79.813	66.581	0,04
JP3592200004	Toshiba Corp	3.100	JPY	67.994	66.126	0,04
JP3595200001	Tosoh Corp	12.900	JPY	192.291	142.209	0,08
JP3633400001	Toyota Motor Corp	4.703	JPY	287.960	274.022	0,15

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3933800009	Z Holdings Corporation	35.900	JPY	144.910	111.971	0,06
				<b>9.457.971</b>	<b>8.453.015</b>	<b>4,52</b>
	<b>Jersey</b>					
GB00B19NLV48	Experian Plc	3.772	GBP	99.609	101.865	0,05
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	2.559	GBP	221.476	155.223	0,09
				<b>321.085</b>	<b>257.088</b>	<b>0,14</b>
	<b>Canada</b>					
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Limited	2.024	CAD	81.727	77.295	0,04
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	9.376	CAD	359.274	100.383	0,05
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	2.947	CAD	67.785	66.409	0,04
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	3.621	CAD	134.940	95.923	0,05
CA0641491075	Bank Of Nova Scotia	1.670	CAD	65.255	65.241	0,03
CA05534B7604	Bce Inc	3.912	CAD	160.550	153.519	0,08
CA1125851040	Brookfield Asset Mgmt -a-/ltd	661	CAD	27.647	28.029	0,01
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	16.514	CAD	506.092	216.095	0,12
CA1363751027	Canadian National Railway	1.263	CAD	91.376	94.466	0,05
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Co	158	CAD	32.287	33.354	0,02
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	1.802	CAD	195.414	104.047	0,06
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	4.290	CAD	134.549	98.101	0,05
CA15135U1093	Cenovus Energy	41.876	CAD	396.989	80.844	0,04
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	3.427	CAD	204.443	177.490	0,09
CA1254911003	Ci Financial Corp	13.315	CAD	223.337	126.444	0,07
CA2908761018	Emera Inc	2.307	CAD	79.533	87.037	0,05
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	6.572	CAD	123.895	122.989	0,07
CA29250N1050	Enbridge Inc.	3.827	CAD	105.997	106.609	0,06
CA3359341052	First Quantum Minerals Ltd	5.124	CAD	24.901	25.044	0,01
CA9611485090	George Weston Ltd	568	CAD	36.799	38.854	0,02
CA4488112083	Hydro One Ltd	2.715	CAD	47.068	46.767	0,02
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	5.019	CAD	195.235	150.936	0,08
CA45823T1066	Intact Fin	916	CAD	74.493	75.735	0,04
CA4969024047	Kinross Gold Corp	10.059	CAD	45.725	38.634	0,02
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	3.051	CAD	96.999	85.966	0,05
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	2.724	CAD	114.963	134.340	0,07
CA5592224011	Magna International Inc	5.741	CAD	318.717	175.264	0,09
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	20.541	CAD	367.690	246.729	0,14
CA6330671034	National Bank Of Canada	4.701	CAD	254.802	173.809	0,09
CA67077M1086	Nutrien Ltd	2.042	CAD	60.809	66.781	0,04
CA6837151068	Open Text Corp	2.195	CAD	69.425	73.426	0,04
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	10.213	CAD	365.454	172.243	0,09
CA7392391016	Power Corp.canada	11.132	CAD	257.477	171.321	0,09
CA7481932084	Quebecor Inc	5.614	CAD	137.167	118.723	0,06
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	2.162	CAD	92.183	83.345	0,04
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	3.794	CAD	261.546	224.816	0,13
CA82509L1076	Shopify Inc	237	CAD	102.634	94.991	0,05
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	5.588	CAD	224.732	171.961	0,09
CA8672241079	Suncor Energy	2.493	CAD	32.517	38.062	0,02
CA87807B1076	Tc Energy Corporation	665	CAD	26.670	28.276	0,02
CA8849037095	Thomson Reuters Corp	477	CAD	28.084	31.089	0,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	4.329	CAD	208.529	176.063	0,09
CA94106B1013	Waste Connections Inc	508	USD	35.524	38.092	0,02
CA92938W2022	Wsp Global Inc	609	CAD	30.472	33.085	0,02
				<b>6.501.705</b>	<b>4.548.627</b>	<b>2,43</b>
	<b>Liechtenstein</b>					
LI0355147575	Liechtenst	2.486	CHF	143.108	134.244	0,07
				<b>143.108</b>	<b>134.244</b>	<b>0,07</b>
	<b>Pays-Bas</b>					
NL0012969182	Adyen B.v.	63	EUR	49.119	51.541	0,03
NL0000687663	Aercap Holdings Nv	3.838	USD	235.901	84.630	0,05
NL0013267909	Akzo Nobel	340	EUR	20.242	21.661	0,01
NL0010273215	Asml Holding Nv	1.092	EUR	283.451	281.075	0,15
NL0012059018	Exor N.v.	2.010	EUR	99.021	100.294	0,05
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	6.617	EUR	122.753	149.525	0,08
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	15.579	EUR	46.874	35.990	0,02
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	5.736	EUR	235.894	224.797	0,12
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	2.153	EUR	44.396	45.429	0,02
NL0000388619	Unilever Nv.	5.164	EUR	297.743	245.636	0,13
				<b>1.435.394</b>	<b>1.240.578</b>	<b>0,66</b>
	<b>Portugal</b>					
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	16.375	EUR	55.682	63.592	0,03
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	3.399	EUR	55.891	37.511	0,02
				<b>111.573</b>	<b>101.103</b>	<b>0,05</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0012221716	Abb	114.018	CHF	1.639.612	1.938.876	1,04
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	20.466	CHF	1.441.643	780.573	0,42
CH0432492467	Alcon Inc.	17.574	CHF	782.540	866.925	0,46
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	31.276	CHF	502.913	170.454	0,09
CH0012410517	Baloise Holding/namen	6.768	CHF	1.023.443	858.859	0,46
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	351	CHF	643.845	680.940	0,36
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	148	CHF	608.716	926.480	0,50
CH0198251305	Coca-cola Hbc	1.947	GBP	39.127	40.574	0,02
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	188.608	CHF	3.143.569	1.508.864	0,81
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	697	CHF	863.276	466.293	0,25
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	440	CHF	626.762	515.240	0,28
CH0114405324	Garmin	1.893	USD	172.160	137.295	0,07
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	2.913	CHF	1.072.892	1.240.938	0,66
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	369	CHF	796.709	1.105.155	0,59
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	278	CHF	250.245	320.256	0,17
CH0023868554	Implenia Ag	4.596	CHF	363.706	157.183	0,08
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	819	CHF	493.615	515.970	0,28
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	29.865	CHF	1.578.022	1.056.026	0,56
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	6.126	CHF	458.188	407.992	0,22
CH0108503795	Meyer Burger	186.909	CHF	317.705	28.803	0,02
CH0038863350	Nestle / Act Nom	111.231	CHF	5.029.842	11.061.922	5,90



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	111.153	CHF	7.231.059	8.875.567	4,74
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	34.362	CHF	6.825.799	10.791.386	5,77
CH0024638196	Schindler Holding/partic	5.075	CHF	1.070.424	1.077.930	0,58
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	376	CHF	430.378	353.064	0,19
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	73.371	CHF	758.423	1.062.412	0,57
CH0418792922	Sika Ltd	5.940	CHF	755.424	950.103	0,51
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	5.877	CHF	906.409	1.024.949	0,55
CH0002178181	Stadler Rail Ag	5.422	CHF	206.036	242.363	0,13
CH0126881561	Swiss Re-namen	28.701	CHF	2.516.986	2.139.947	1,14
CH0008742519	Swisscom /nam.	3.199	CHF	1.625.789	1.664.120	0,89
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	8.486	CHF	640.337	323.147	0,17
CH0244767585	Ubs Group Ag	248.861	CHF	7.060.453	2.251.197	1,20
CH0311864901	Vat Group Ltd	3.801	CHF	452.033	509.334	0,27
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	909	CHF	51.770	43.268	0,02
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	9.511	CHF	2.606.331	3.266.077	1,75
				<b>54.986.181</b>	<b>59.360.482</b>	<b>31,72</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0105046009	Aena Sme Sa	1.047	EUR	201.902	110.621	0,06
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	40.792	EUR	141.099	126.260	0,07
ES0130670112	Endesa Sa	7.264	EUR	188.472	150.149	0,08
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	7.479	EUR	73.337	71.333	0,04
ES0148396007	Inditex	4.645	EUR	115.696	116.676	0,06
ES0173516115	Repsol Sa	21.472	EUR	293.728	189.933	0,10
				<b>1.014.234</b>	<b>764.972</b>	<b>0,41</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	2.906	USD	154.951	221.871	0,12
US00287Y1091	Abbvie Inc	2.529	USD	220.840	186.432	0,10
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	516	USD	26.693	29.696	0,02
US00724F1012	Adobe Inc	84	USD	25.143	25.865	0,01
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc	645	USD	28.166	28.383	0,02
US00130H1059	Aes Corp.	7.286	USD	77.722	95.874	0,05
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	975	USD	69.629	86.308	0,05
US0171751003	Alleghany Corp (del)	133	USD	104.505	71.079	0,04
US0200021014	Allstate Corp	774	USD	83.652	68.695	0,04
US02005N1000	Ally Financial Inc	3.796	USD	101.752	52.999	0,03
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	224	USD	241.444	251.831	0,13
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	364	USD	335.672	409.527	0,22
US0231351067	Amazon Com Inc	341	USD	474.888	643.279	0,35
US0258161092	American Express Co.	1.578	USD	171.072	130.709	0,07
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	760	USD	121.305	75.357	0,04
US0311621009	Amgen Inc	943	USD	194.206	184.971	0,10
US0378331005	Apple Inc	3.790	USD	472.766	932.484	0,51
US0382221051	Applied Materials Inc	3.159	USD	192.551	140.048	0,07
US03965L1008	Arconic Inc	5.001	USD	138.815	77.710	0,04
US04621X1081	Assurant Inc	979	USD	136.178	98.597	0,05
US00206R1023	At & T	9.890	USD	343.162	278.938	0,15
US0605051046	Bank Of America Corp	3.764	USD	77.709	77.317	0,04
US0718131099	Baxter Intl Inc	759	USD	55.032	59.624	0,03

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US0865161014	Best Buy Co Inc.	950	USD	68.380	52.393	0,03
US09062X1037	Biogen Inc	143	USD	39.874	43.774	0,02
US1011371077	Boston Scientific Corp.	1.691	USD	49.504	53.387	0,03
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	2.106	USD	128.318	113.579	0,06
US1491231015	Caterpillar Inc.	327	USD	33.489	36.714	0,02
US12504L1098	Cbre Group -a-	3.492	USD	171.468	127.410	0,07
US12508E1010	Cdk Global Inc	682	USD	22.795	21.677	0,01
US1567821046	Cerner Corp	2.336	USD	165.205	142.370	0,08
US1667641005	Chevron Corporation	1.219	USD	82.620	85.463	0,05
US1255231003	Cigna Corporation	126	USD	19.333	21.600	0,01
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	6.276	USD	164.991	238.704	0,13
US1729674242	Citigroup Inc	4.819	USD	306.833	196.390	0,10
US1746101054	Citizens Financial Group Inc	2.370	USD	82.681	43.133	0,02
US1890541097	Clorox Co *opa*	195	USD	31.607	32.687	0,02
US1912161007	Coca-cola Co.	6.281	USD	368.555	268.915	0,14
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	887	USD	51.977	56.951	0,03
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	1.950	USD	64.051	64.866	0,03
US20825C1045	Conocophillips	5.820	USD	275.217	173.439	0,09
US22160K1051	Costco Wholesale Corp	77	USD	21.160	21.243	0,01
US2310211063	Cummins Inc	421	USD	52.632	55.121	0,03
US1266501006	Cvs Health Corp	384	USD	20.154	22.043	0,01
US2566771059	Dollar General Corporation	242	USD	29.291	35.359	0,02
US2600031080	Dover Corp.	1.900	USD	174.324	154.311	0,08
US26441C2044	Duke Energy	1.467	USD	107.237	114.801	0,06
US2774321002	Eastman Chemical Co	435	USD	19.826	19.605	0,01
US28176E1082	Edwards Lifesciences	130	USD	24.286	23.725	0,01
US2855121099	Electronic Arts	776	USD	83.260	75.210	0,04
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	8.778	USD	203.916	122.726	0,07
US30231G1022	Exxon Mobil Corp	696	USD	25.394	25.570	0,01
US30303M1027	Facebook Inc -a-	1.939	USD	332.812	312.930	0,17
US34354P1057	Flowserve Corp	990	USD	22.279	22.884	0,01
US3156161024	F5 Networks Inc.	1.090	USD	142.208	112.455	0,06
US3696041033	General Electric Co	8.193	USD	60.604	62.941	0,03
US3703341046	General Mills Inc	1.667	USD	88.660	85.113	0,05
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	746	USD	50.846	53.961	0,03
US37959E1029	Globe Life Inc	431	USD	28.600	30.013	0,02
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	387	USD	58.741	57.885	0,03
US4361061082	Hollyfrontier Corp	1.680	USD	90.159	39.841	0,02
US4364401012	Hologic Inc	825	USD	26.041	28.018	0,01
US4370761029	Home Depot Inc.	685	USD	121.822	123.746	0,07
US4592001014	Ibm Corp	981	USD	101.601	105.291	0,06
US4581401001	Intel Corp.	3.228	USD	184.469	169.030	0,09
US4612021034	Intuit	347	USD	78.966	77.220	0,04
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	81	USD	36.482	38.810	0,02
US4781601046	Johnson & Johnson	3.165	USD	434.732	401.559	0,21
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	506	USD	69.853	49.438	0,03
US4851703029	Kansas City Southern	636	USD	91.162	78.262	0,04
US4943681035	Kimberly Clark Corp	1.268	USD	172.218	156.878	0,08
US5010441013	Kroger Co.	796	USD	21.761	23.198	0,01
US5128071082	Lam Research Corp	593	USD	141.799	137.702	0,07

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US5312294094	Liberty Media Corp	2.324	USD	116.138	71.258	0,04
US5324571083	Lilly (eli) & Co	589	USD	70.275	79.055	0,04
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	1.265	USD	145.066	105.321	0,06
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	1.264	USD	324.050	295.424	0,16
US58155Q1031	Mckesson Corp	398	USD	53.782	52.087	0,03
US58933Y1055	Merck	3.655	USD	245.205	272.090	0,15
US59156R1086	Metlife Inc	5.459	USD	250.303	161.466	0,09
US5951121038	Micron Technology Inc	510	USD	21.208	20.755	0,01
US5949181045	Microsoft Corp.	6.553	USD	392.706	999.937	0,54
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	1.710	USD	77.149	82.858	0,04
US61174X1090	Monster Beverage Corp	2.417	USD	167.187	131.568	0,07
US6153691059	Moody S Corp	805	USD	198.761	164.733	0,09
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	279	USD	36.487	35.881	0,02
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	1.428	USD	66.424	62.562	0,03
US6541061031	Nike Inc B	1.239	USD	95.784	99.188	0,05
US65473P1057	Nisource Inc	3.362	USD	75.100	81.225	0,04
US67066G1040	Nvidia Corp.	513	USD	123.287	130.839	0,07
US6907421019	Owens Corning Inc	2.972	USD	192.661	111.600	0,06
US7010941042	Parker-hannifin	605	USD	74.901	75.940	0,04
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	701	USD	73.455	64.936	0,03
US7134481081	Pepsico Inc	850	USD	102.908	98.772	0,05
US7170811035	Pfizer Inc.	3.693	USD	107.499	116.628	0,06
US7512121010	Polo Ralph Lauren	785	USD	82.530	50.759	0,03
US6935061076	Ppg Industries Inc.	833	USD	69.858	67.379	0,04
US69351T1060	Ppl Corp	3.749	USD	81.544	89.523	0,05
US7458671010	Pultegroup Inc	7.811	USD	303.835	168.684	0,09
US74736K1016	Qorvo Inc	692	USD	64.055	53.985	0,03
US7475251036	Qualcomm Inc.	2.256	USD	195.249	147.666	0,08
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	75	USD	31.539	35.433	0,02
US7591EP1005	Regions Financial Corp	15.058	USD	228.048	130.687	0,07
US7607591002	Republic Services Inc.	1.827	USD	141.914	132.685	0,07
US79466L3024	Salesforce Com Inc	507	USD	72.952	70.629	0,04
US8330341012	Snap-on Inc	546	USD	84.873	57.488	0,03
US78409V1044	S&p Global Shs	758	USD	196.063	179.720	0,10
US87165B1035	Synchrony Financial	5.876	USD	190.625	91.477	0,05
US8716071076	Synopsys Inc.	295	USD	35.018	36.760	0,02
US8718291078	Sysco Corp.	2.479	USD	161.885	109.446	0,06
US87612E1064	Target Corp	1.141	USD	81.418	102.637	0,05
US8725401090	Tjx Companies Inc	3.732	USD	218.325	172.637	0,09
US89400J1079	Transunion	555	USD	35.716	35.538	0,02
US9024941034	Tyson Foods Inc.-a-	901	USD	68.012	50.449	0,03
US9078181081	Union Pacific Corp.	716	USD	93.113	97.708	0,05
US9113631090	United Rentals Inc.	720	USD	91.414	71.684	0,04
US9130171096	United Technologies Corp	2.019	USD	190.022	184.272	0,10
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	1.201	USD	202.731	289.787	0,15
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	213	USD	43.785	49.039	0,03
US92826C8394	Visa Inc -a	2.160	USD	359.414	336.726	0,18
US9285634021	Vmware Inc	207	USD	23.535	24.254	0,01
US9297401088	Wabtec Corp	568	USD	25.954	26.451	0,01
US2546871060	Walt Disney	668	USD	65.837	62.435	0,03



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US9633201069	Whirlpool Corp.	681	USD	97.271	56.534	0,03
US9884981013	Yum Brands Shs	835	USD	59.535	55.366	0,03
US88579Y1010	3m Co	270	USD	34.750	35.662	0,02
				<b>15.733.202</b>	<b>15.225.558</b>	<b>8,14</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>103.911.386</b>	<b>101.347.021</b>	<b>54,16</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Australie</b>						
XS1014018045	Aust & Nz B 2.5% 14-16.01.24	300.000	EUR	369.496	348.432	0,19
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	400.000	EUR	454.788	403.391	0,21
				<b>824.284</b>	<b>751.823</b>	<b>0,40</b>
<b>Chili</b>						
CH0496632628	Bc Sant Cl 0.135% 19-29.08.29	1.000.000	CHF	999.000	790.000	0,42
CH0465767785	Bc Sant Cl 0.384% 19-27.09.24	1.000.000	CHF	1.000.000	919.250	0,50
CH0505011889	Credito 0.25% 19-29.10.25	500.000	CHF	500.075	452.500	0,24
				<b>2.499.075</b>	<b>2.161.750</b>	<b>1,16</b>
<b>Allemagne</b>						
CH0479514272	Dt Bahn Fin 0.10% 19-19.06.29	520.000	CHF	520.260	500.630	0,27
				<b>520.260</b>	<b>500.630</b>	<b>0,27</b>
<b>France</b>						
CH0479514264	Bfcm 0.2% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	1.000.170	967.750	0,52
FR0013234333	France 1.75% 16-25.06.39 Oat	250.000	EUR	344.459	327.167	0,17
XS0096412548	Rff 5.25% 99-07.12.28	1.000.000	GBP	2.472.060	1.610.652	0,86
				<b>3.816.689</b>	<b>2.905.569</b>	<b>1,55</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	200.000	EUR	218.053	186.559	0,10
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	300.000	EUR	332.583	304.887	0,16
US80283LAJ26	Santander 4% 14-13.03.24	2.000.000	USD	2.017.183	1.999.501	1,07
				<b>2.567.819</b>	<b>2.490.947</b>	<b>1,33</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	150.000	EUR	161.887	147.076	0,08
				<b>161.887</b>	<b>147.076</b>	<b>0,08</b>
<b>Canada</b>						
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	100.000	USD	97.802	84.434	0,05
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	200.000	EUR	226.832	201.617	0,11
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	500.000	USD	501.272	494.138	0,26
XS1985806600	Tor Dom Bk 0.375% 19-25.04.24 Regs	100.000	EUR	113.392	99.864	0,05
US89114QCD88	Tor Dom Bk 1.90% 19-01.12.22	500.000	USD	494.352	486.876	0,26
				<b>1.433.650</b>	<b>1.366.929</b>	<b>0,73</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Luxembourg</b>						
XS1964701822	Aroundtown 5.375% 19-21.03.29	800.000	USD	797.252	864.386	0,46
XS0070553820	Bei 0% 96-26 Senior	1.000.000	USD	480.945	909.391	0,49
XS0282506657	Bei 2.15% 07-18.1.27 Senior	100.000.000	JPY	1.230.893	1.045.668	0,56
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	200.000	EUR	221.340	194.952	0,10
				<b>2.730.430</b>	<b>3.014.397</b>	<b>1,61</b>
<b>Pays-Bas</b>						
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	1.000.000	CHF	1.001.250	921.250	0,49
XS1890845875	Iberdrola I 3.25% 19-perp	100.000	EUR	114.100	107.226	0,06
				<b>1.115.350</b>	<b>1.028.476</b>	<b>0,55</b>
<b>Nigéria</b>						
CH0511762038	Africa Fina 0.522% 19-20.12.23	500.000	CHF	500.000	471.250	0,25
				<b>500.000</b>	<b>471.250</b>	<b>0,25</b>
<b>Autriche</b>						
XS0782697071	Oebb Inf 3.375% 12-18.5.32	500.000	EUR	654.431	734.329	0,39
				<b>654.431</b>	<b>734.329</b>	<b>0,39</b>
<b>Philippines</b>						
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	300.000.000	JPY	3.071.089	3.200.378	1,71
				<b>3.071.089</b>	<b>3.200.378</b>	<b>1,71</b>
<b>Suisse</b>						
CH0506668869	Ubs Group F 3% 19-perp	400.000	CHF	400.000	357.000	0,19
				<b>400.000</b>	<b>357.000</b>	<b>0,19</b>
<b>Espagne</b>						
XS2018637913	San Con 0.375% 19-27.6.24 Regs	200.000	EUR	222.365	202.386	0,11
ES0000012932	Spain 4.2% 05-31.01.37	450.000	EUR	766.744	708.909	0,38
				<b>989.109</b>	<b>911.295</b>	<b>0,49</b>
<b>Corée du Sud</b>						
CH0506668851	Eibk 0% 19-27.05.25	500.000	CHF	503.695	477.500	0,26
CH0419040917	Hyucap 0.7325% 19-26.02.24	1.000.000	CHF	1.000.000	979.250	0,52
				<b>1.503.695</b>	<b>1.456.750</b>	<b>0,78</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	300.000	USD	305.360	319.872	0,17
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	400.000	EUR	436.243	397.068	0,21
US037833DN70	Apple Inc 2.05% 19-11.09.26	100.000	USD	97.969	99.453	0,05
CH0474977722	Bac 0.252% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	1.000.000	935.500	0,50
CH0365501474	Citigp 0.5% 17-22.11.24	2.000.000	CHF	2.014.100	1.931.999	1,04
CH0467182405	Citigroup I 0.75% 19-02.04.26	1.000.000	CHF	1.007.340	960.000	0,51
US233851AF18	Daimler Fin 3.875% 11-15.9.21 144a	1.400.000	USD	1.421.066	1.332.310	0,71
US369604BD45	Gen Elec 2.7% 12-9.10.2022	2.000.000	USD	1.868.428	1.906.829	1,02

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	100.000	EUR	108.234	101.478	0,05
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	200.000	USD	195.640	172.452	0,09
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	2.168.000	USD	2.577.760	3.074.209	1,65
CH0517825268	Jackson Nat 0.125% 20-14.07.28	600.000	CHF	600.510	540.150	0,29
US58933YAA38	Merck 3.875% 10-15.1.21	500.000	USD	515.039	488.768	0,26
CH0471297959	Ny Life Gbl 0.25% 19-18.10.27 Regs	1.000.000	CHF	1.003.480	958.500	0,51
XS2049583607	Prolos Eu 0.625% 19-10.09.31	200.000	EUR	217.931	178.259	0,10
				<b>13.369.100</b>	<b>13.396.847</b>	<b>7,16</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>36.156.868</b>	<b>34.895.446</b>	<b>18,65</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	1.528	EUR	180.346	83.300	0,04
				<b>180.346</b>	<b>83.300</b>	<b>0,04</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	9.177	GBP	100.991	61.302	0,03
				<b>100.991</b>	<b>61.302</b>	<b>0,03</b>
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	3.280	CAD	18.940	19.911	0,01
				<b>18.940</b>	<b>19.911</b>	<b>0,01</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	6.535	USD	38.045	32.057	0,02
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	5.427	USD	166.933	124.971	0,07
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	1.427	USD	178.842	142.254	0,09
US6819361006	Omega Healthcare Investors	5.438	USD	216.723	139.641	0,07
US8666741041	Sun Communities Inc	517	USD	76.277	62.453	0,03
US92276F1003	Ventas Inc.	2.754	USD	197.576	71.412	0,04
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	1.570	USD	23.703	25.277	0,01
				<b>898.099</b>	<b>598.065</b>	<b>0,33</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>1.198.376</b>	<b>762.578</b>	<b>0,41</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>141.266.630</b>	<b>137.005.045</b>	<b>73,22</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00BVXBYN70	Gam St Chf -ins- /cap	717.126	CHF	7.152.328	7.526.236	4,02
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	348.345	USD	2.348.494	2.239.640	1,20
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	133.275	USD	6.327.151	6.119.980	3,27
				<b>15.827.973</b>	<b>15.885.856</b>	<b>8,49</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	87.741	USD	9.164.580	9.531.880	5,09
LU1637934073	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Chf	92.039	CHF	8.864.283	8.692.171	4,65
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	22.045	USD	2.252.702	1.914.122	1,02
				<b>20.281.565</b>	<b>20.138.173</b>	<b>10,76</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>36.109.538</b>	<b>36.024.029</b>	<b>19,25</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>36.109.538</b>	<b>36.024.029</b>	<b>19,25</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>177.376.168</b>	<b>173.029.074</b>	<b>92,47</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Suisse	31,91	Fonds d'investissements	19,26
Etats-Unis d'Amérique	15,63	Pharmacie et cosmétique	13,33
Luxembourg	12,37	Banques et autres institutions financières	8,96
Irlande	9,04	Alimentation, boissons	7,23
Japon	4,52	Holdings et sociétés financières	6,35
Royaume-Uni	3,43	Supranational	4,66
France	3,19	Electrotechnique, électronique	4,60
Canada	3,17	Assurances	4,30
Philippines	1,71	Chimie	2,44
Allemagne	1,49	Construction, matériel de construction	2,33
Pays-Bas	1,21	Transmission de nouvelles	2,00
Chili	1,16	Obligations d'Etats et de villes étrangers	1,80
Espagne	0,90	Internet Software	1,79
Corée du Sud	0,78	Mécanique, outillage	1,58
Australie	0,40	Commerce de détail et grands magasins	1,57
Autriche	0,39	Véhicules routiers	1,22
Italie	0,31	Pétrole	1,17
Nigéria	0,25	Articles de bureau et ordinateurs	1,07
Jersey	0,14	Sociétés immobilières	1,05
Finlande	0,12	Energie et service des eaux	0,89
Belgique	0,12	Services divers	0,77
Bermudes	0,10	Santé, éducation et services sociaux	0,72
Liechtenstein	0,07	Circulation et transport	0,60
Portugal	0,05	Arts graphiques et maisons d'édition	0,48
Curacao	0,01	Biens de consommation divers	0,44
	<b>92,47</b>	Textile et habillement	0,26
		Métaux non ferreux	0,22
		Industrie aéronautique et spatiale	0,22
		Biotechnologie	0,20
		Industrie horlogère	0,17
		Papier et bois	0,16
		Caoutchouc et pneus	0,12
		Service d'environnement et de recyclage	0,09
		Photographie et optique	0,08
		Métaux et pierres précieuses	0,07
		Gastronomie	0,07
		Mines, aciéries	0,06
		Maisons de commerce diverses	0,06
		Divers	0,04
		Agriculture et pêche	0,04
			<b>92,47</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0974264930	Ageas Nv	2.863	EUR	151.007	108.536	0,25
BE0003818359	Galapagos Genomics Nv	230	EUR	36.679	41.630	0,09
BE0003565737	Kbc Groupe Sa	178	EUR	8.323	7.480	0,02
BE0003826436	Telenet Group Holding	1.791	EUR	79.566	49.145	0,11
BE0003739530	Ucb	1.178	EUR	91.782	93.062	0,21
BE0974320526	Umicore Sa	258	EUR	8.748	8.217	0,02
				<b>376.105</b>	<b>308.070</b>	<b>0,70</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG169621056	Bunge Ltd	318	USD	10.755	11.891	0,03
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	556	USD	29.877	30.403	0,07
				<b>40.632</b>	<b>42.294</b>	<b>0,10</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	655	USD	8.829	8.053	0,02
				<b>8.829</b>	<b>8.053</b>	<b>0,02</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	812	EUR	211.407	167.191	0,38
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	1.636	EUR	325.278	256.655	0,57
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	728	EUR	80.130	67.384	0,15
DE0005190003	Bmw-bayer.motorenwerke	833	EUR	51.894	39.247	0,09
DE000A1DAHH0	Brenntag	552	EUR	18.075	18.674	0,04
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	674	EUR	57.997	59.548	0,14
DE000CBK1001	Commerzbank Akt Nach Kap	2.388	EUR	8.860	7.901	0,02
DE0005439004	Continental Ag	665	EUR	44.575	43.631	0,10
DE0006062144	Covestro Ag	2.394	EUR	103.781	66.721	0,15
DE0007100000	Daimler Ag / Namen-akt.	624	EUR	18.576	17.172	0,04
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	6.416	EUR	41.280	38.297	0,09
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	1.050	EUR	132.122	131.250	0,30
DE0005552004	Deutsche Post Ag	2.986	EUR	89.430	73.978	0,17
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	14.376	EUR	178.192	169.838	0,39
DE000ENAG999	E.on Se	5.107	EUR	45.260	48.215	0,11
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-.	3.498	EUR	89.662	66.707	0,15
DE0005785604	Fresenius Se & Co Kгаа	740	EUR	24.868	25.108	0,06
DE0006602006	Gea Group Ag	2.093	EUR	58.403	39.191	0,09
DE0006047004	Heidelbergcement Ag	283	EUR	10.240	11.062	0,03
DE0006048432	Henkel / Vorzug	1.540	EUR	143.303	112.728	0,26
DE000KGX8881	Kion Group	643	EUR	25.647	25.360	0,06
DE0005470405	Lanxess Ag	1.111	EUR	46.436	40.463	0,09
DE0006599905	Merck Kгаа	793	EUR	73.824	74.241	0,17
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	755	EUR	161.344	138.996	0,32
DE0006969603	Puma Se	1.099	EUR	65.402	59.786	0,14

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
DE0007164600	Sap Se	3.215	EUR	315.652	330.501	0,74
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	3.040	EUR	325.743	235.509	0,54
DE000SHL1006	Siemens Healthineers Ag	290	EUR	12.289	10.453	0,02
DE000SYM9999	Symrise Ag	922	EUR	90.702	78.370	0,18
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	24.970	EUR	67.964	56.407	0,13
DE000UNSE018	Uniper Se	1.795	EUR	47.162	40.370	0,09
DE000A1ML7J1	Vonovia Se /namen	359	EUR	15.885	16.105	0,04
				<b>2.981.383</b>	<b>2.567.059</b>	<b>5,85</b>
	<b>Finlande</b>					
FI0009007132	Fortum Corporation	4.252	EUR	65.180	56.871	0,13
FI0009007835	Metso Corp	2.962	EUR	71.514	64.335	0,15
FI0009013296	Neste Oil Oyj	2.318	EUR	72.897	71.510	0,16
FI0009000681	Nokia Oy	20.211	EUR	57.489	57.985	0,13
FI0009014377	Orion Corp (new)- Shs-b-	951	EUR	36.571	35.453	0,08
				<b>303.651</b>	<b>286.154</b>	<b>0,65</b>
	<b>France</b>					
FR0000120073	Air Liquide	1.902	EUR	214.180	221.868	0,51
FR0000051732	Atos Act.	285	EUR	17.914	17.596	0,04
FR0000120628	Axa	9.502	EUR	213.603	150.018	0,34
FR0000131104	Bnp Paribas	5.318	EUR	179.354	146.298	0,33
FR0000039299	Bolllore Sa	22.131	EUR	85.135	55.549	0,13
FR0000120503	Bouygues	2.353	EUR	91.709	62.872	0,14
FR0000125338	Capgemini Se	650	EUR	47.300	50.050	0,11
FR0000120222	Cnp Assurances	7.978	EUR	151.801	71.164	0,16
FR0000120644	Danone.	2.749	EUR	158.858	161.201	0,37
FR0010242511	Edf	1.644	EUR	12.369	11.814	0,03
FR0000130452	Eiffage Sa	980	EUR	87.245	63.210	0,14
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	1.356	EUR	192.342	133.268	0,30
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	5.282	EUR	88.286	50.316	0,11
FR0010533075	Getlink Se	1.003	EUR	10.997	11.023	0,03
FR0000052292	Hermes International	177	EUR	124.255	111.298	0,25
FR0010259150	Ipsen	247	EUR	11.765	11.653	0,03
FR0000121485	Kering Sa	289	EUR	155.686	137.535	0,31
FR0000120321	L Oreal	983	EUR	249.059	234.839	0,54
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	1.941	EUR	134.471	113.510	0,26
FR0000121261	Michelin B /nom.	1.136	EUR	91.577	92.084	0,21
FR0000133308	Orange	1.663	EUR	19.068	18.518	0,04
FR0000121501	Peugeot Sa	1.525	EUR	18.817	18.552	0,04
FR0000125007	Saint-gobain	4.224	EUR	142.971	93.625	0,21
FR0000120578	Sanofi	4.097	EUR	321.617	328.333	0,75
FR0000121972	Schneider Electric Se	2.399	EUR	240.845	188.513	0,43
FR0000121220	Sodexo	1.165	EUR	115.815	71.811	0,16
FR0000130809	Ste Gen.paris -a-	2.773	EUR	48.130	42.560	0,10
FR0010613471	Suez Environnement Cie	7.084	EUR	89.841	65.711	0,15
FR0000051807	Teleperform.se	283	EUR	64.159	53.713	0,12
FR0000120271	Total Sa	9.122	EUR	448.104	322.828	0,74
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	366	EUR	22.903	24.588	0,06
FR0000124141	Veolia Environnement	4.522	EUR	99.647	88.066	0,20

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000125486	Vinci.	807	EUR	64.752	60.848	0,14
				<b>4.014.575</b>	<b>3.284.832</b>	<b>7,48</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
GB0006731235	Associated British Foods Plc	3.083	GBP	95.892	63.199	0,14
GB0009895292	Astrazeneca Plc	724	GBP	54.655	59.038	0,13
GB0031348658	Barclays Plc	26.879	GBP	31.026	28.586	0,07
GB0007980591	Bp Plc	25.801	GBP	95.557	100.357	0,22
GB0031743007	Burberry Group Plc	1.711	GBP	25.289	25.609	0,06
GB00B033F229	Centrica Plc	26.960	GBP	12.939	11.602	0,03
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	959	GBP	11.710	13.698	0,03
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	4.405	GBP	71.602	75.395	0,17
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	5.584	GBP	31.070	28.664	0,07
GB0031274896	Marks And Spencer /new	24.792	GBP	54.964	27.803	0,06
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	47.954	GBP	88.975	49.584	0,11
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	5.494	GBP	52.482	24.834	0,06
GB0032089863	Next Plc	289	GBP	19.295	13.299	0,03
GB0006825383	Persimmon Plc	1.669	GBP	56.070	36.146	0,08
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	223	GBP	13.992	15.498	0,04
GB00B2B0DG97	Relx Plc	4.524	GBP	106.122	88.546	0,20
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	1.801	GBP	75.073	75.680	0,17
GB00B8C3BL03	Sage Grp	3.143	GBP	20.153	21.019	0,05
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	1.843	GBP	28.457	29.876	0,07
GB0004082847	Standard Chartered Plc	6.913	GBP	35.711	34.826	0,08
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	42.671	GBP	75.716	56.659	0,13
GB00B10RZP78	Unilever Plc	1.984	GBP	107.747	91.374	0,21
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	61.370	GBP	113.986	78.367	0,18
				<b>1.278.483</b>	<b>1.049.659</b>	<b>2,39</b>
	<b>Irlande</b>					
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	502	USD	90.688	74.693	0,17
IE00BY9D5467	Allergan Plc	100	USD	15.604	16.140	0,04
IE00BD1RP616	Bank Of Ireland Group Plc	10.111	EUR	20.019	17.431	0,04
IE0001827041	Crh Plc	3.030	EUR	86.811	75.296	0,17
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	1.120	USD	80.169	79.301	0,18
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	1.592	USD	57.444	39.116	0,09
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	1.040	USD	90.543	85.475	0,19
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	3.022	EUR	88.341	77.726	0,18
				<b>529.619</b>	<b>465.178</b>	<b>1,06</b>
	<b>Italie</b>					
IT0000062072	Assicurazioni Generali Spa	7.830	EUR	130.437	97.170	0,22
IT0003128367	Enel	22.042	EUR	124.208	139.723	0,32
IT0003132476	Eni Spa Roma	15.267	EUR	215.336	140.761	0,31
NL0011585146	Ferrari N.v.	545	EUR	76.257	77.145	0,18
IT0000072618	Intesa Sanpaolo Spa	11.250	EUR	18.203	16.745	0,04
IT0003796171	Poste Italiane Spa	8.416	EUR	85.054	64.972	0,15
IT0003497176	Telecom Italia Spa/risp.n-cv	134.216	EUR	68.220	48.385	0,11



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IT0005239360	Unicredit Spa	3.752	EUR	31.677	26.816	0,06
				<b>749.392</b>	<b>611.717</b>	<b>1,39</b>
	<b>Japon</b>					
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	900	JPY	21.252	20.241	0,05
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	1.500	JPY	23.234	25.459	0,06
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	5.500	JPY	68.163	77.587	0,18
JP3220580009	Calbee Inc	400	JPY	9.164	9.864	0,02
JP3242800005	Canon Inc.	1.300	JPY	26.701	25.889	0,06
JP3566800003	Central Japan Railway Co	100	JPY	15.038	14.622	0,03
JP3511800009	Chiba Bank	8.800	JPY	44.903	35.139	0,08
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	3.100	JPY	73.182	60.219	0,14
JP3551500006	Denso Corp	1.200	JPY	36.121	35.366	0,08
JP3160400002	Eisai Co.ltd	400	JPY	25.164	26.782	0,06
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	3.300	JPY	54.656	53.991	0,12
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	100	JPY	41.792	37.306	0,08
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	1.200	JPY	24.548	24.810	0,06
JP3818000006	Fujitsu Ltd	500	JPY	40.091	41.176	0,09
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	1.900	JPY	18.308	17.484	0,04
JP3788600009	Hitachi Ltd	3.000	JPY	93.059	79.600	0,18
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	2.500	JPY	53.731	51.286	0,12
JP3837800006	Hoya Corp	200	JPY	14.879	15.534	0,04
JP3294460005	Inpex Corp	3.100	JPY	27.456	15.933	0,04
JP3143900003	Itochu Techno-solutions	800	JPY	18.249	20.835	0,05
JP3292200007	Jtekt Corp	1.500	JPY	10.204	9.307	0,02
JP3496400007	Kddi Corp.	2.700	JPY	72.526	72.712	0,17
JP3982100004	Lawson Inc	1.100	JPY	55.065	55.068	0,13
JP3626800001	Lixil Group Shs	5.400	JPY	83.374	61.315	0,14
JP3897700005	Mitsubishi Chemical Hldgs Corp	2.400	JPY	13.514	13.024	0,03
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	4.500	JPY	63.197	60.593	0,14
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	1.100	JPY	17.636	17.370	0,04
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	2.500	JPY	77.160	63.844	0,15
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	300	JPY	13.696	13.859	0,03
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	100	JPY	34.827	35.128	0,08
JP3743000006	Nippon Meat Packers	700	JPY	21.865	22.249	0,05
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co.ltd.	200	JPY	9.537	9.556	0,02
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	2.100	JPY	30.553	31.947	0,07
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	1.400	JPY	71.100	57.027	0,13
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	3.700	JPY	76.123	54.819	0,12
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	2.900	JPY	71.476	82.675	0,18
JP3201200007	Olympus Corp	1.600	JPY	17.047	21.099	0,05
JP3200450009	Orix Corp	3.500	JPY	40.526	38.426	0,09
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	400	JPY	13.091	14.287	0,03
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	4.700	JPY	74.076	56.859	0,13
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	900	JPY	71.322	81.525	0,18
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	400	JPY	16.693	17.955	0,04
JP3435000009	Sony Corp	2.000	JPY	124.251	108.413	0,24
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	9.700	JPY	26.441	26.286	0,06
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	2.300	JPY	73.685	60.658	0,14
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	1.100	JPY	29.994	32.131	0,07

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3336560002	Suntory B & F	1.600	JPY	54.220	55.178	0,13
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Tokyo	700	JPY	17.916	10.933	0,02
JP3544000007	Teijin Ltd	2.200	JPY	38.005	33.988	0,08
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	1.800	JPY	91.139	75.219	0,17
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	400	JPY	79.878	68.736	0,16
JP3592200004	Toshiba Corp	900	JPY	18.627	18.083	0,04
JP3633400001	Toyota Motor Corp	800	JPY	45.861	43.906	0,10
JP3933800009	Z Holdings Corporation	13.200	JPY	49.601	38.780	0,09
				<b>2.333.917</b>	<b>2.152.078</b>	<b>4,90</b>
<b>Jersey</b>						
GB00B19NLV48	Experian Plc	853	GBP	21.256	21.698	0,05
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	634	GBP	50.464	36.224	0,08
				<b>71.720</b>	<b>57.922</b>	<b>0,13</b>
<b>Canada</b>						
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Limited	227	CAD	8.649	8.166	0,02
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	3.786	CAD	135.052	38.181	0,09
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	553	CAD	12.003	11.738	0,03
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	1.685	CAD	37.517	42.045	0,10
CA05534B7604	Bce Inc	619	CAD	22.405	22.881	0,05
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	5.888	CAD	143.979	72.574	0,16
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	926	CAD	92.237	50.362	0,11
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	2.202	CAD	42.759	47.430	0,11
CA15135U1093	Cenovus Energy	2.060	CAD	15.077	3.746	0,01
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	1.400	CAD	93.137	68.298	0,16
CA1254911003	Ci Financial Corp	5.680	CAD	86.749	50.807	0,12
CA2908761018	Emera Inc	572	CAD	18.608	20.327	0,05
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	3.304	CAD	64.370	58.241	0,13
CA9611485090	George Weston Ltd	512	CAD	31.301	32.990	0,08
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	2.629	CAD	95.855	74.471	0,16
CA45823T1066	Intact Fin	227	CAD	17.420	17.679	0,04
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	1.114	CAD	33.420	29.566	0,07
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	350	CAD	16.215	16.259	0,04
CA5592224011	Magna International Inc	655	CAD	18.376	18.835	0,04
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	8.875	CAD	147.847	100.413	0,22
CA67077M1086	Nutrien Ltd	412	CAD	11.577	12.692	0,03
CA6837151068	Open Text Corp	951	CAD	28.383	29.965	0,07
CA7392391016	Power Corp.canada	5.009	CAD	106.788	72.612	0,16
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	1.061	CAD	42.688	38.526	0,09
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	603	CAD	33.058	33.656	0,08
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	2.839	CAD	123.133	82.292	0,18
CA8672241079	Suncor Energy	3.337	CAD	41.072	47.990	0,11
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	546	CAD	20.959	20.917	0,05
CA94106B1013	Waste Connections Inc	129	USD	8.512	9.111	0,02
CA92938W2022	Wsp Global Inc	225	CAD	10.624	11.514	0,03
				<b>1.559.770</b>	<b>1.144.284</b>	<b>2,61</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Liechtenstein</b>						
LI0355147575	Liechtenst	44	CHF	2.068	2.238	0,01
				<b>2.068</b>	<b>2.238</b>	<b>0,01</b>
<b>Pays-Bas</b>						
NL0012969182	Adyen B.v.	70	EUR	54.721	53.942	0,12
NL0000687663	Aercap Holdings Nv	392	USD	22.701	8.142	0,02
NL0013267909	Akzo Nobel	956	EUR	53.707	57.370	0,13
NL0010273215	Asml Holding Nv	1.519	EUR	329.572	368.281	0,85
NL0012059018	Exor N.v.	1.703	EUR	87.101	80.041	0,18
NL0010877643	Fiat Chrysler Automobiles N.v	3.237	EUR	22.125	21.274	0,05
NL0011821202	Ing Group Nv	1.665	EUR	9.963	7.961	0,02
NL0012015705	Just Eat Takeaway.com N.v.	257	EUR	18.057	17.656	0,04
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	4.964	EUR	89.550	105.659	0,24
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	6.470	EUR	17.232	14.079	0,03
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	4.313	EUR	145.318	159.214	0,36
NL0009538784	Nxp Semiconductor	987	USD	84.718	74.597	0,17
NL0013654783	Prosus Bearer Rg Shs -n-	880	EUR	56.100	55.572	0,13
NL0000379121	Randstad Holding (eur 0.1)	1.129	EUR	35.591	36.320	0,08
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	5.117	EUR	91.099	101.700	0,23
NL0000388619	Unilever Nv.	5.616	EUR	299.050	251.625	0,57
NL0000395903	Wolters Kluwer Nv	1.420	EUR	95.243	91.136	0,21
				<b>1.511.848</b>	<b>1.504.569</b>	<b>3,43</b>
<b>Autriche</b>						
AT0000730007	Andritz Ag Graz	329	EUR	8.990	9.403	0,02
AT0000652011	Erste Group Bank Ag	1.458	EUR	28.092	24.618	0,06
				<b>37.082</b>	<b>34.021</b>	<b>0,08</b>
<b>Portugal</b>						
PTBES0AM0007	Banco Espirito Santo Sa/reg	151.900	EUR	159.719	0	0,00
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	18.988	EUR	60.480	69.458	0,16
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	1.340	EUR	20.297	13.929	0,03
				<b>240.496</b>	<b>83.387</b>	<b>0,19</b>
<b>Suisse</b>						
CH0012221716	Abb	5.809	CHF	103.673	93.046	0,21
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	1.912	CHF	101.903	68.689	0,16
CH0432492467	Alcon Inc.	1.346	CHF	64.179	62.543	0,14
CH0012410517	Baloise Holding/namen	360	CHF	50.953	43.031	0,10
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	7	CHF	11.282	12.791	0,03
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	3	CHF	13.929	17.690	0,04
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	9.270	CHF	110.846	69.854	0,16
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	14	CHF	12.681	8.822	0,02
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	15	CHF	21.515	16.545	0,04
CH0114405324	Garmin	206	USD	15.828	14.073	0,03
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	140	CHF	54.804	56.177	0,13
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	31	CHF	67.383	87.454	0,20

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0023868554	Implenia Ag	169	CHF	11.423	5.444	0,01
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	1.518	CHF	67.659	50.560	0,12
CH0038863350	Nestle / Act Nom	6.096	CHF	489.425	571.045	1,29
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	5.808	CHF	405.895	436.840	1,00
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	1.793	CHF	392.718	530.396	1,21
CH0024638196	Schindler Holding/partic	292	CHF	54.577	58.420	0,13
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	2.130	CHF	19.429	29.052	0,07
CH0418792922	Sika Ltd	168	CHF	22.174	25.311	0,06
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	399	CHF	69.332	65.545	0,15
CH0002178181	Stadler Rail Ag	102	CHF	3.422	4.295	0,01
CH0126881561	Swiss Re-namen	1.653	CHF	139.821	116.091	0,26
CH0008742519	Swisscom /nam.	209	CHF	90.659	102.409	0,23
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	388	CHF	22.349	13.917	0,03
CH0244767585	Ubs Group Ag	11.706	CHF	142.110	99.744	0,23
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	513	CHF	145.512	165.935	0,38
				<b>2.705.481</b>	<b>2.825.719</b>	<b>6,44</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0167050915	Acs	6	EUR	0	107	0,00
ES0105046009	Aena Sme Sa	685	EUR	118.920	68.171	0,16
ES0113900J37	Banco Santander --- Reg.shs	27.167	EUR	101.060	60.256	0,14
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	37.811	EUR	123.415	110.238	0,25
ES0130960018	Enagas	2.833	EUR	64.037	51.263	0,12
ES0130670112	Endesa Sa	3.890	EUR	93.958	75.738	0,17
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	22.812	EUR	180.832	204.944	0,47
ES0148396007	Inditex	5.640	EUR	152.434	133.442	0,30
ES0173093024	Red Electrica Corporacion. Sa	820	EUR	12.138	13.419	0,03
ES0173516115	Repsol Sa	12.184	EUR	160.305	101.517	0,23
ES0178430E18	Telefonica Sa	2.539	EUR	11.300	10.597	0,02
				<b>1.018.399</b>	<b>829.692</b>	<b>1,89</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US00287Y1091	Abbvie Inc	474	USD	29.720	32.913	0,07
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	172	USD	8.396	9.324	0,02
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	382	USD	25.489	31.852	0,07
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	69	USD	70.181	73.069	0,17
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	70	USD	68.115	74.182	0,17
US0231351067	Amazon Com Inc	89	USD	155.608	158.145	0,37
US0258161092	American Express Co.	416	USD	44.829	32.457	0,07
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	134	USD	17.951	12.515	0,03
US0311621009	Amgen Inc	324	USD	67.840	59.863	0,14
US0378331005	Apple Inc	1.013	USD	196.418	234.765	0,54
US0382221051	Applied Materials Inc	940	USD	53.338	39.253	0,09
US03965L1008	Arconic Inc	2.562	USD	51.005	37.499	0,09
US00206R1023	At & T	3.523	USD	125.925	93.593	0,21
US0865161014	Best Buy Co Inc.	337	USD	21.751	17.506	0,04
US09062X1037	Biogen Inc	52	USD	13.682	14.994	0,03
US1011371077	Boston Scientific Corp.	708	USD	19.558	21.054	0,05
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	1.494	USD	90.136	75.895	0,17
US12508E1010	Cdk Global Inc	428	USD	13.499	12.814	0,03

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US1567821046	Cerner Corp	1.031	USD	65.299	59.187	0,13
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	1.907	USD	71.450	68.320	0,16
US1729674242	Citigroup Inc	1.013	USD	59.691	38.886	0,09
US1746101054	Citizens Financial Group Inc	1.097	USD	33.795	18.806	0,04
US1912161007	Coca-cola Co.	2.269	USD	87.170	91.504	0,21
US20825C1045	Conocophillips	651	USD	18.597	18.274	0,04
US2310211063	Cummins Inc	173	USD	20.409	21.335	0,05
US25470F3029	Discovery Com Inc / -c-	697	USD	12.111	11.142	0,03
US2600031080	Dover Corp.	914	USD	75.666	69.921	0,16
US2774321002	Eastman Chemical Co	267	USD	11.483	11.335	0,03
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	3.525	USD	73.695	46.422	0,11
US30303M1027	Facebook Inc -a-	500	USD	72.113	76.008	0,17
US34964C1062	Fr Brnd Hom Sec	523	USD	23.460	20.615	0,05
US3156161024	F5 Networks Inc.	157	USD	15.262	15.257	0,03
US3696041033	General Electric Co	2.153	USD	15.028	15.580	0,04
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	189	USD	12.156	12.877	0,03
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	83	USD	11.888	11.694	0,03
US4361061082	Hollyfrontier Corp	874	USD	42.053	19.523	0,04
US4364401012	Hologic Inc	453	USD	13.493	14.491	0,03
US4370761029	Home Depot Inc.	70	USD	11.747	11.911	0,03
US4448591028	Humana Inc.	81	USD	21.762	23.181	0,05
US4592001014	Ibm Corp	345	USD	33.717	34.879	0,08
US4612021034	Intuit	109	USD	23.406	22.848	0,05
US4781601046	Johnson & Johnson	1.034	USD	127.531	123.571	0,29
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	253	USD	31.789	23.284	0,05
US4851703029	Kansas City Southern	186	USD	24.257	21.559	0,05
US4943681035	Kimberly Clark Corp	542	USD	68.849	63.163	0,14
US5010441013	Kroger Co.	364	USD	9.390	9.992	0,02
US5128071082	Lam Research Corp	207	USD	52.177	45.277	0,10
US5312294094	Liberty Media Corp	593	USD	27.922	17.127	0,04
US5324571083	Lilly (eli) & Co	120	USD	13.510	15.171	0,03
US5341871094	Lincoln National Corp.	303	USD	16.168	7.268	0,02
US5018892084	Lkq	589	USD	10.876	11.010	0,03
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	567	USD	60.707	44.466	0,10
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	102	USD	22.545	22.455	0,05
US58155Q1031	Mckesson Corp	138	USD	15.861	17.012	0,04
US58933Y1055	Merck	1.425	USD	102.117	99.922	0,23
US59156R1086	Metlife Inc	2.793	USD	121.170	77.815	0,18
US5949181045	Microsoft Corp.	1.928	USD	206.805	277.116	0,64
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	633	USD	26.949	28.891	0,07
US61174X1090	Monster Beverage Corp	399	USD	19.768	20.458	0,05
US6153691059	Moody S Corp	66	USD	12.622	12.722	0,03
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	115	USD	14.192	13.931	0,03
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	375	USD	16.460	15.475	0,04
US6541061031	Nike Inc B	457	USD	33.338	34.461	0,08
US65473P1057	Nisource Inc	859	USD	18.107	19.548	0,04
US67066G1040	Nvidia Corp.	126	USD	28.574	30.270	0,07
US6907421019	Owens Corning Inc	1.640	USD	95.622	58.007	0,13
US7010941042	Parker-hannifin	232	USD	27.103	27.430	0,06
US7134481081	Pepsico Inc	405	USD	49.454	44.329	0,10

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US7170811035	Pfizer Inc.	749	USD	20.573	22.281	0,05
US6935061076	Ppg Industries Inc.	358	USD	28.330	27.276	0,06
US69351T1060	Ppl Corp	1.404	USD	28.817	31.580	0,07
US7458671010	Pultegroup Inc	3.318	USD	101.968	67.494	0,15
US74736K1016	Qorvo Inc	230	USD	20.414	16.901	0,04
US7475251036	Qualcomm Inc.	715	USD	56.628	44.083	0,10
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	149	USD	12.667	10.904	0,02
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	29	USD	11.507	12.905	0,03
US7591EP1005	Regions Financial Corp	7.039	USD	101.267	57.544	0,13
US7607591002	Republic Services Inc.	424	USD	28.084	29.005	0,07
US7841171033	Sei Investments Co	352	USD	20.095	14.866	0,03
US78409V1044	S&p Global Shs	327	USD	78.378	73.029	0,17
US8716071076	Synopsys Inc.	161	USD	18.034	18.897	0,04
US8718291078	Sysco Corp.	937	USD	59.651	38.966	0,09
US87612E1064	Target Corp	427	USD	34.293	36.180	0,08
US8725401090	Tjx Companies Inc	1.212	USD	55.071	52.810	0,12
US89400J1079	Transunion	273	USD	16.578	16.466	0,04
US9024941034	Tyson Foods Inc.-a-	294	USD	20.341	15.506	0,04
US9113631090	United Rentals Inc.	332	USD	35.297	31.135	0,07
US9130171096	United Technologies Corp	738	USD	65.542	63.445	0,14
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	175	USD	37.888	39.774	0,09
US91529Y1064	Unum Group	923	USD	25.484	12.626	0,03
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc	97	USD	9.390	9.075	0,02
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	66	USD	12.802	14.313	0,03
US92826C8394	Visa Inc -a	753	USD	110.528	110.570	0,25
US9285634021	Vmware Inc	108	USD	11.587	11.920	0,03
US9297401088	Wabtec Corp	231	USD	9.960	10.133	0,02
US9633201069	Whirlpool Corp.	301	USD	36.227	23.537	0,05
US3848021040	Ww Grainger Inc	94	USD	28.786	21.289	0,05
US9884981013	Yum Brands Shs	307	USD	20.655	19.174	0,04
				<b>4.269.597</b>	<b>3.901.103</b>	<b>8,90</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>24.033.047</b>	<b>21.158.029</b>	<b>48,22</b>
<b>Obligations</b>						
	<b>Australie</b>					
XS1997077364	Transurban 1.45% 19-16.05.29	200.000	EUR	200.457	189.984	0,43
				<b>200.457</b>	<b>189.984</b>	<b>0,43</b>
	<b>France</b>					
FR0013463676	Essilor 0.75% 19-27.11.31	100.000	EUR	98.537	92.563	0,21
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	300.000	EUR	396.075	401.001	0,91
XS0144628053	Snf 5.375% 02-18.03.27	100.000	GBP	144.770	145.878	0,33
FR0013410818	Socgen 1.75% 19-22.03.29	500.000	EUR	539.195	474.255	1,09
FR0013409612	Societe Par 1.125% 19-25.05.34	200.000	EUR	197.734	218.304	0,50
FR0013424868	Vivendi 0.625% 19-11.06.25	100.000	EUR	99.912	97.523	0,22
				<b>1.476.223</b>	<b>1.429.524</b>	<b>3,26</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Royaume-Uni</b>						
XS2051655095	Coca-cola E 0.70% 19-12.09.31	100.000	EUR	99.565	87.863	0,20
XS2021471433	Motability 0.375% 19-03.01.26	150.000	EUR	149.865	143.592	0,33
				<b>249.430</b>	<b>231.455</b>	<b>0,53</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott II F 0.375% 19-19.11.27	100.000	EUR	99.256	92.357	0,21
XS1883355197	Abbott II F 1.5% 18-27.9.26 Regs	100.000	EUR	101.082	100.850	0,23
XS2013626010	Zurich Fina 1.625% 19-17.06.39	300.000	EUR	327.972	273.075	0,62
				<b>528.310</b>	<b>466.282</b>	<b>1,06</b>
<b>Italie</b>						
US465410AH18	Italy 6.875% 93-27.09.23	150.000	USD	182.763	157.345	0,36
				<b>182.763</b>	<b>157.345</b>	<b>0,36</b>
<b>Canada</b>						
XS1945965611	Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	250.000	EUR	249.285	265.195	0,60
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	50.000	USD	44.891	39.766	0,09
US78013XZU52	Rbc 2.55% 19-16.07.24	100.000	USD	89.080	93.089	0,21
US89114QCB23	Tor Dom Bk 3.25% 19-11.03.24	400.000	USD	367.880	381.000	0,88
				<b>751.136</b>	<b>779.050</b>	<b>1,78</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS1964701822	Aroundtown 5.375% 19-21.03.29	400.000	USD	351.064	407.098	0,93
XS2018637327	Heid. C Lux 1.125% 19-01.12.27	100.000	EUR	99.127	91.816	0,21
				<b>450.191</b>	<b>498.914</b>	<b>1,14</b>
<b>Pays-Bas</b>						
USN30707AJ75	Enel Fin 4.25% 18-14.09.23 Regs	300.000	USD	275.570	281.105	0,64
XS2056374353	Mondelez In 0.875% 19-1.10.31	300.000	EUR	295.647	280.197	0,64
				<b>571.217</b>	<b>561.302</b>	<b>1,28</b>
<b>Philippines</b>						
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	20.000.000	JPY	166.078	200.970	0,46
				<b>166.078</b>	<b>200.970</b>	<b>0,46</b>
<b>Roumanie</b>						
XS2027596530	Romania 2.124% 19-16.7.31 Regs	150.000	EUR	154.770	137.829	0,31
				<b>154.770</b>	<b>137.829</b>	<b>0,31</b>
<b>Espagne</b>						
XS2013745703	Bbva 1% 19-21.06.26	100.000	EUR	99.738	92.528	0,21
US05964HAF29	Santander 3.8% 17-23.02.28	400.000	USD	349.345	358.361	0,82
ES00000127A2	Spanish Gov 1.95% 15-30.07.30	150.000	EUR	174.477	168.885	0,38
				<b>623.560</b>	<b>619.774</b>	<b>1,41</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Corée du Sud</b>						
US50064FAR55	Korea 2% 19-19.06.24	200.000	USD	175.197	189.423	0,43
				<b>175.197</b>	<b>189.423</b>	<b>0,43</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US026874DH71	Aig 3.9% 16-01.04.26	400.000	USD	366.901	379.537	0,86
US023135BC96	Amazon Com 3.15% 18-22.08.27	300.000	USD	271.024	301.299	0,69
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	100.000	EUR	99.248	93.503	0,21
XS1811435251	Bafc 1.662% 18-25.04.28	500.000	EUR	518.785	488.604	1,11
XS0168658853	Citigp 5.15% 03-21.05.26	100.000	GBP	148.571	126.153	0,29
XS2100788780	Gen Mills 0.45% 20-15.01.26	100.000	EUR	99.959	95.586	0,22
XS2043678841	Gldm Sachs 0.125% 19-19.8.24 Regs	150.000	EUR	149.234	138.653	0,32
US45905CAA27	Ibrd 4.75% 05-15.02.35	100.000	USD	66.545	133.566	0,30
US58013MEH34	Mc Donald S 5.7% 09-1.2.39	100.000	USD	76.015	114.332	0,26
XS1197270819	Mondelez 1.625% 15-08.03.27	200.000	EUR	209.254	202.930	0,46
US61747YDU64	Mor St 4.1%13-22.5.23	300.000	USD	278.791	281.865	0,64
				<b>2.284.327</b>	<b>2.356.028</b>	<b>5,36</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>7.813.659</b>	<b>7.817.880</b>	<b>17,81</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	970	EUR	107.870	49.810	0,11
FR0000121964	Klepierre	1.269	EUR	38.714	22.296	0,05
				<b>146.584</b>	<b>72.106</b>	<b>0,16</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	2.458	GBP	16.104	15.466	0,04
				<b>16.104</b>	<b>15.466</b>	<b>0,04</b>
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	9.447	CAD	51.474	54.017	0,12
				<b>51.474</b>	<b>54.017</b>	<b>0,12</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	2.159	USD	62.898	46.830	0,11
US6819361006	Omega Healthcare Investors	412	USD	15.026	9.965	0,02
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	5.302	USD	138.073	80.406	0,18
US92936U1097	Wp Carey Inc Reit	234	USD	12.399	12.386	0,03
				<b>228.396</b>	<b>149.587</b>	<b>0,34</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>442.558</b>	<b>291.176</b>	<b>0,66</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>32.289.264</b>	<b>29.267.085</b>	<b>66,69</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en EUR)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00B6TLWG59	Gam Star Cat Bd Inst Cl Eur	130.239	EUR	1.722.243	1.750.151	3,99
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	76.713	USD	463.687	464.578	1,06
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	30.545	USD	1.367.173	1.321.181	3,01
				<b>3.553.103</b>	<b>3.535.910</b>	<b>8,06</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	19.343	USD	1.991.381	1.979.341	4,51
LU1637934156	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Eur	26.567	EUR	2.622.503	2.540.841	5,78
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	19.263	USD	2.000.990	1.575.449	3,59
				<b>6.614.874</b>	<b>6.095.631</b>	<b>13,88</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>10.167.977</b>	<b>9.631.541</b>	<b>21,94</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>10.167.977</b>	<b>9.631.541</b>	<b>21,94</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>42.457.241</b>	<b>38.898.626</b>	<b>88,63</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Luxembourg	15,02	Fonds d'investissements	22,06
Etats-Unis d'Amérique	14,60	Banques et autres institutions financières	8,04
France	10,90	Holdings et sociétés financières	7,50
Irlande	10,18	Pharmacie et cosmétique	6,78
Suisse	6,44	Electrotechnique, électronique	4,27
Allemagne	5,85	Assurances	3,94
Japon	4,90	Alimentation, boissons	3,78
Pays-Bas	4,71	Commerce de détail et grands magasins	2,90
Canada	4,51	Internet Software	2,91
Espagne	3,30	Obligations d'Etats et de villes étrangers	2,39
Royaume-Uni	2,96	Transmission de nouvelles	2,26
Italie	1,75	Pétrole	2,24
Belgique	0,70	Energie et service des eaux	2,24
Finlande	0,65	Construction, matériel de construction	2,03
Philippines	0,46	Circulation et transport	1,83
Australie	0,43	Sociétés immobilières	1,63
Corée du Sud	0,43	Chimie	1,63
Roumanie	0,31	Articles de bureau et ordinateurs	1,12
Portugal	0,19	Mécanique, outillage	1,07
Jersey	0,13	Biens de consommation divers	1,01
Bermudes	0,10	Arts graphiques et maisons d'édition	0,98
Autriche	0,08	Textile et habillement	0,91
Curacao	0,02	Véhicules routiers	0,82
Liechtenstein	0,01	Services divers	0,77
	<b>88,63</b>	Supranational	0,76
		Santé, éducation et services sociaux	0,48
		Caoutchouc et pneus	0,42
		Gastronomie	0,33
		Papier et bois	0,32
		Métaux non ferreux	0,28
		Biotechnologie	0,26
		Industrie aéronautique et spatiale	0,25
		Maisons de commerce diverses	0,09
		Service d'environnement et de recyclage	0,09
		Mines, aciéries	0,07
		Métaux et pierres précieuses	0,06
		Photographie et optique	0,05
		Industrie horlogère	0,03
		Agriculture et pêche	0,03
			<b>88,63</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Bermudes</b>						
BMG0450A1053	Arch Capital Gp Ltd Bermuda	86	USD	2.212	2.448	0,02
BMG0750C1082	Axalta Coating Systems Ltd	779	USD	23.101	13.453	0,11
BMG169621056	Bunge Ltd	83	USD	3.041	3.405	0,03
BMG3223R1088	Everest Reinsurance Group Ltd	17	USD	2.973	3.271	0,03
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	310	USD	24.939	18.600	0,14
BMG7496G1033	Renaissancere Hld Ltd	96	USD	18.893	14.335	0,12
				<b>75.159</b>	<b>55.512</b>	<b>0,45</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	798	USD	27.000	10.765	0,09
				<b>27.000</b>	<b>10.765</b>	<b>0,09</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB0006731235	Associated British Foods Plc	707	GBP	24.344	15.902	0,13
GB0009895292	Astrazeneca Plc	96	GBP	7.850	8.590	0,07
GB0031348658	Barclays Plc	10.656	GBP	13.324	12.435	0,10
GB0007980591	Bp Plc	7.886	GBP	31.638	33.656	0,27
GB0031743007	Burberry Group Plc	316	GBP	5.059	5.190	0,04
GB00B033F229	Centrica Plc	30.465	GBP	36.346	14.385	0,12
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	223	GBP	2.950	3.495	0,03
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	1.701	GBP	36.334	31.944	0,26
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	1.718	GBP	10.355	9.677	0,08
GB00B0SWJX34	Lse Group	65	GBP	5.661	5.867	0,05
GB0031274896	Marks And Spencer /new	4.401	GBP	10.541	5.416	0,04
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	908	GBP	9.371	4.504	0,04
GB0032089863	Next Plc	63	GBP	4.649	3.181	0,03
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	73	GBP	4.962	5.567	0,04
GB00B2B0DG97	Relx Plc	1.069	GBP	24.618	22.958	0,18
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	426	GBP	19.236	19.642	0,16
GB00BKKMKR23	Rsa Insurance Group Plc	1.094	GBP	5.488	5.703	0,05
GB00B8C3BL03	Sage Grp	405	GBP	2.813	2.972	0,02
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	303	GBP	5.068	5.389	0,04
GB0004082847	Standard Chartered Plc	1.994	GBP	11.158	11.022	0,09
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	9.747	GBP	19.790	14.201	0,11
GB0008847096	Tesco Plc	1.293	GBP	3.385	3.668	0,03
GB00B10RZP78	Unilever Plc	474	GBP	28.303	23.953	0,19
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	14.509	GBP	29.114	20.329	0,16
				<b>352.357</b>	<b>289.646</b>	<b>2,33</b>
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	161	USD	26.904	26.285	0,21
IE00BY9D5467	Allergan Plc	45	USD	7.606	7.970	0,06
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	317	USD	33.322	24.628	0,20

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	461	USD	18.166	12.429	0,10
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	329	USD	30.246	29.668	0,24
IE00BLS09M33	Pentair Plc	100	USD	2.901	2.976	0,02
				<b>119.145</b>	<b>103.956</b>	<b>0,83</b>
	<b>Jersey</b>					
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	298	GBP	26.095	18.682	0,15
				<b>26.095</b>	<b>18.682</b>	<b>0,15</b>
	<b>Canada</b>					
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	322	CAD	7.571	7.499	0,06
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	601	CAD	21.951	16.455	0,13
CA05534B7604	Bce Inc	420	CAD	20.327	17.035	0,14
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	1.444	CAD	41.186	19.529	0,16
CA1363751027	Canadian National Railway	37	CAD	2.736	2.860	0,02
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	719	CAD	21.254	16.993	0,14
CA15135U1093	Cenovus Energy	3.659	CAD	36.030	7.301	0,06
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	231	CAD	11.347	12.365	0,10
CA2908761018	Emera Inc	77	CAD	2.713	3.002	0,02
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	755	CAD	16.657	14.603	0,12
CA29250N1050	Enbridge Inc.	99	CAD	2.803	2.850	0,02
CA9611485090	George Weston Ltd	161	CAD	10.662	11.383	0,09
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	299	CAD	12.522	9.293	0,07
CA45823T1066	Intact Fin	178	CAD	14.797	15.211	0,12
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	218	CAD	7.084	6.348	0,05
CA5592224011	Magna International Inc	145	CAD	4.407	4.575	0,04
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	1.922	CAD	35.228	23.861	0,20
CA67077M1086	Nutrien Ltd	178	CAD	5.418	6.017	0,05
CA6837151068	Open Text Corp	258	CAD	8.341	8.920	0,07
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	975	CAD	36.009	16.995	0,14
CA7392391016	Power Corp.canada	1.272	CAD	32.736	20.233	0,16
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	229	CAD	9.981	9.124	0,07
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	187	CAD	11.105	11.452	0,09
CA82509L1076	Shopify Inc	7	CAD	3.099	2.900	0,02
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	656	CAD	32.551	20.865	0,18
CA8672241079	Suncor Energy	720	CAD	14.101	11.361	0,09
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	187	CAD	7.776	7.860	0,06
CA94106B1013	Waste Connections Inc	53	USD	3.788	4.108	0,03
CA92938W2022	Wsp Global Inc	329	CAD	19.038	18.473	0,15
				<b>453.218</b>	<b>329.471</b>	<b>2,65</b>
	<b>Suisse</b>					
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	60	CHF	113.325	120.304	0,97
CH0198251305	Coca-cola Hbc	130	GBP	2.670	2.800	0,02
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	11.243	CHF	155.648	92.961	0,75
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	83	CHF	82.123	57.389	0,46
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	66	CHF	98.502	79.878	0,64
CH0114405324	Garmin	204	USD	20.364	15.292	0,12
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	3.321	CHF	162.000	121.369	0,97

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	1.665	CHF	136.617	137.409	1,10
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	717	CHF	179.916	232.726	1,88
CH0126881561	Swiss Re-namen	1.584	CHF	147.381	122.064	0,98
CH0008742519	Swisscom /nam.	242	CHF	114.095	130.110	1,04
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	422	CHF	135.690	149.775	1,20
				<b>1.348.331</b>	<b>1.262.077</b>	<b>10,13</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	118	USD	8.350	9.311	0,07
US00287Y1091	Abbvie Inc	349	USD	30.588	26.590	0,21
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	132	USD	6.980	7.851	0,06
US00724F1012	Adobe Inc	25	USD	7.649	7.956	0,06
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc	121	USD	5.401	5.503	0,04
US00130H1059	Aes Corp.	194	USD	2.487	2.638	0,02
US0010551028	Aflac Inc.	225	USD	8.265	7.704	0,06
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	113	USD	10.829	10.338	0,08
US0171751003	Alleghany Corp (del)	8	USD	6.416	4.419	0,04
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	34	USD	37.461	39.506	0,32
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	52	USD	66.265	60.466	0,49
US0231351067	Amazon Com Inc	54	USD	98.607	105.286	0,85
US0258161092	American Express Co.	259	USD	27.645	22.173	0,18
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	73	USD	10.651	7.481	0,06
US0311621009	Amgen Inc	118	USD	23.288	23.922	0,19
US0367521038	Anthem Inc	15	USD	3.246	3.406	0,03
US0378331005	Apple Inc	588	USD	124.033	149.524	1,20
US0382221051	Applied Materials Inc	356	USD	21.645	16.312	0,13
US0394831020	Archer-daniels Midland Co	138	USD	4.513	4.855	0,04
US03965L1008	Arconic Inc	674	USD	16.781	10.824	0,09
US04621X1081	Assurant Inc	136	USD	16.952	14.156	0,11
US00206R1023	At & T	1.344	USD	44.087	39.178	0,31
US0605051046	Bank Of America Corp	923	USD	22.560	19.595	0,16
US0865161014	Best Buy Co Inc.	111	USD	8.072	6.327	0,05
US09062X1037	Biogen Inc	26	USD	7.411	8.226	0,07
US09247X1019	Blackrock Inc	51	USD	27.289	22.438	0,18
US1011371077	Boston Scientific Corp.	314	USD	9.396	10.246	0,08
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	507	USD	27.496	28.260	0,23
US1273871087	Cadence Design Systems	47	USD	2.884	3.104	0,02
US1491231015	Caterpillar Inc.	30	USD	3.141	3.481	0,03
US12508E1010	Cdk Global Inc	105	USD	3.587	3.449	0,03
US1567001060	Centurylink Inc	209	USD	1.892	1.977	0,02
US1567821046	Cerner Corp	257	USD	17.965	16.188	0,13
US1667641005	Chevron Corporation	290	USD	20.091	21.013	0,17
US1255231003	Cigna Corporation	26	USD	4.078	4.607	0,04
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	521	USD	19.629	20.481	0,16
US1729674242	Citigroup Inc	604	USD	39.185	25.440	0,20
US1890541097	Clorox Co *opa*	40	USD	6.627	6.930	0,06
US1912161007	Coca-cola Co.	818	USD	47.011	36.197	0,29
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	160	USD	9.584	10.618	0,09
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	404	USD	13.564	13.890	0,11
US20825C1045	Conocophillips	752	USD	46.810	23.162	0,19

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US22160K1051	Costco Wholesale Corp	35	USD	9.832	9.980	0,08
US2283681060	Crown Holdings Inc	94	USD	5.082	5.456	0,04
US2310211063	Cummins Inc	68	USD	8.690	9.202	0,07
US1266501006	Cvs Health Corp	183	USD	13.425	10.857	0,09
US2521311074	Dexcom Inc	13	USD	3.112	3.501	0,03
US25470F3029	Discovery Com Inc / -c-	181	USD	3.407	3.175	0,03
US25746U1097	Dominion Energy Inc	302	USD	26.958	21.801	0,18
US2600031080	Dover Corp.	37	USD	2.982	3.106	0,02
US26441C2044	Duke Energy	196	USD	14.645	15.852	0,13
US2774321002	Eastman Chemical Co	182	USD	8.479	8.478	0,07
US2786421030	Ebay Inc	105	USD	2.979	3.156	0,03
US2788651006	Ecolab Inc.	30	USD	4.554	4.675	0,04
US28176E1082	Edwards Lifesciences	29	USD	5.538	5.470	0,04
US2855121099	Electronic Arts	98	USD	10.703	9.817	0,08
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	1.372	USD	30.028	19.825	0,16
US30231G1022	Exxon Mobil Corp	224	USD	8.354	8.505	0,07
US30303M1027	Facebook Inc -a-	329	USD	58.466	54.877	0,44
US3167731005	Fifth Third Bancorp	754	USD	11.176	11.197	0,09
US34354P1057	Flowserve Corp	121	USD	2.783	2.891	0,02
US35137L1052	Fox --- Registered Shs -a-	131	USD	3.163	3.096	0,02
US3156161024	F5 Networks Inc.	123	USD	16.335	13.115	0,11
US3696041033	General Electric Co	1.182	USD	8.937	9.385	0,08
US3703341046	General Mills Inc	62	USD	2.955	3.272	0,03
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	140	USD	9.754	10.466	0,08
US37959E1029	Globe Life Inc	218	USD	20.644	15.689	0,13
US3802371076	Godaddy Inc	47	USD	2.702	2.684	0,02
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	99	USD	23.044	15.304	0,12
US42824C1099	Hewlett Packard Ent Co	273	USD	2.564	2.651	0,02
US4361061082	Hollyfrontier Corp	294	USD	14.867	7.206	0,06
US4364401012	Hologic Inc	144	USD	4.646	5.054	0,04
US4370761029	Home Depot Inc.	117	USD	21.269	21.845	0,18
US40434L1052	Hp Inc	139	USD	2.138	2.413	0,02
US4448591028	Humana Inc.	14	USD	3.767	4.396	0,04
US4592001014	Ibm Corp	168	USD	17.785	18.636	0,15
US4581401001	Intel Corp.	628	USD	36.311	33.987	0,27
US45866F1049	Intercont Exch	57	USD	4.248	4.603	0,04
US4612021034	Intuit	60	USD	13.957	13.800	0,11
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	16	USD	7.366	7.923	0,06
US47233W1099	Jefferies Financial Group Inc	725	USD	17.200	9.911	0,08
US4781601046	Johnson & Johnson	431	USD	58.320	56.517	0,45
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	34	USD	3.102	3.433	0,03
US48203R1041	Juniper Networks Inc.	195	USD	3.787	3.732	0,03
US4851703029	Kansas City Southern	53	USD	7.324	6.741	0,05
US4878361082	Kellogg Co	124	USD	8.773	7.439	0,06
US4943681035	Kimberly Clark Corp	149	USD	20.895	19.053	0,15
US5010441013	Kroger Co.	197	USD	5.505	5.934	0,05
US5128071082	Lam Research Corp	71	USD	16.789	17.040	0,14
US5312296073	Liberty Media Corp	290	USD	12.073	9.170	0,07
US5324571083	Lilly (eli) & Co	194	USD	27.552	26.912	0,22
US5018892084	Lkq	246	USD	4.921	5.045	0,04

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	206	USD	24.573	17.726	0,14
US56585A1025	Marathon Petroleum Corp	165	USD	10.636	3.897	0,03
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	169	USD	42.610	40.824	0,33
US58155Q1031	Mckesson Corp	44	USD	6.270	5.951	0,05
US58933Y1055	Merck	493	USD	33.750	37.931	0,30
US59156R1086	Metlife Inc	604	USD	27.324	18.464	0,15
US5951121038	Micron Technology Inc	103	USD	4.378	4.332	0,03
US5949181045	Microsoft Corp.	978	USD	110.035	154.241	1,23
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	328	USD	15.126	16.426	0,13
US61174X1090	Monster Beverage Corp	284	USD	19.997	15.978	0,13
US6153691059	Moody S Corp	93	USD	23.816	19.670	0,16
US6174464486	Morgan Stanley	147	USD	4.997	4.998	0,04
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	55	USD	7.352	7.311	0,06
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	375	USD	18.040	16.980	0,14
US6541061031	Nike Inc B	281	USD	22.205	23.250	0,19
US65473P1057	Nisource Inc	412	USD	9.407	10.288	0,08
US6687711084	Nortonlifelock Rg	164	USD	2.934	3.068	0,02
US6293775085	Nrg Energy Inc	291	USD	11.386	7.933	0,06
US67066G1040	Nvidia Corp.	85	USD	20.881	22.406	0,18
US6907421019	Owens Corning Inc	297	USD	18.154	11.527	0,09
US6974351057	Palo Alto Networks Inc	13	USD	2.158	2.131	0,02
US7010941042	Parker-hannifin	96	USD	12.149	12.454	0,10
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	121	USD	11.583	11.585	0,09
US7134481081	Pepsico Inc	285	USD	38.815	34.229	0,27
US7170811035	Pfizer Inc.	558	USD	16.603	18.213	0,15
US7185461040	Phillips 66	51	USD	2.576	2.736	0,02
US6935061076	Ppg Industries Inc.	194	USD	25.206	16.218	0,13
US69351T1060	Ppl Corp	602	USD	13.384	14.857	0,12
US7458671010	Pultegroup Inc	781	USD	29.167	17.432	0,14
US74736K1016	Qorvo Inc	75	USD	7.618	6.047	0,05
US7475251036	Qualcomm Inc.	281	USD	24.822	19.010	0,15
US74834L1008	Quest Diagnostics Inc.	147	USD	15.226	11.804	0,09
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	13	USD	5.588	6.348	0,05
US7591EP1005	Regions Financial Corp	2.143	USD	35.615	19.223	0,15
US7607591002	Republic Services Inc.	208	USD	17.811	15.612	0,13
US79466L3024	Salesforce Com Inc	78	USD	11.472	11.230	0,09
US7841171033	Sei Investments Co	363	USD	23.083	16.821	0,14
US8243481061	Sherwin-williams Co	30	USD	17.525	13.786	0,11
US82968B1035	Sirius Xm Holdings Inc	2.836	USD	18.239	14.010	0,11
US83088M1027	Skyworks Solutions Inc	59	USD	6.674	5.273	0,04
US8330341012	Snap-on Inc	132	USD	20.796	14.364	0,12
US78409V1044	S&p Global Shs	92	USD	23.082	22.545	0,18
US8545021011	Stanley Black & Decker Inc	37	USD	3.636	3.700	0,03
US87165B1035	Synchrony Financial	321	USD	5.349	5.165	0,04
US8716071076	Synopsys Inc.	77	USD	9.343	9.917	0,08
US8718291078	Sysco Corp.	276	USD	20.253	12.594	0,10
US74144T1088	T Rowe Price Group Inc.	128	USD	16.901	12.499	0,10
US87612E1064	Target Corp	157	USD	13.227	14.596	0,12
US4278661081	The Hershey Co	23	USD	2.902	3.048	0,02
US8725401090	Tjx Companies Inc	474	USD	26.791	22.662	0,18



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US89400J1079	Transunion	82	USD	5.394	5.427	0,04
US9078181081	Union Pacific Corp.	96	USD	12.761	13.540	0,11
US9113631090	United Rentals Inc.	59	USD	8.387	6.071	0,05
US9130171096	United Technologies Corp	260	USD	25.013	24.526	0,20
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	120	USD	29.318	29.926	0,24
US91529Y1064	Unum Group	243	USD	7.278	3.647	0,03
US92220P1057	Varian Medical Systems Inc	37	USD	3.880	3.798	0,03
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	34	USD	7.144	8.090	0,06
US92826C8394	Visa Inc -a	298	USD	50.101	48.014	0,39
US9285634021	Vmware Inc	34	USD	3.951	4.117	0,03
US9290891004	Voya Financial	115	USD	4.386	4.663	0,04
US9297401088	Wabtec Corp	76	USD	3.550	3.658	0,03
US2546871060	Walt Disney	129	USD	12.996	12.461	0,10
US96145D1054	Westrock Co	230	USD	9.993	6.500	0,05
US9633201069	Whirlpool Corp.	91	USD	13.722	7.808	0,06
US3848021040	Ww Grainger Inc	28	USD	9.283	6.958	0,06
US9884981013	Yum Brands Shs	128	USD	9.329	8.772	0,07
US88579Y1010	3m Co	17	USD	2.237	2.321	0,02
				<b>2.684.485</b>	<b>2.476.908</b>	<b>19,88</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>5.085.790</b>	<b>4.547.017</b>	<b>36,51</b>
<b>Obligations</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0000320292	Belgium 4.25% 10-28.3.41 Olo	100.000	EUR	193.135	187.987	1,51
				<b>193.135</b>	<b>187.987</b>	<b>1,51</b>
<b>Allemagne</b>						
US500769JD71	Kfw 1.75% 19-14.09.29	100.000	USD	99.900	106.621	0,86
				<b>99.900</b>	<b>106.621</b>	<b>0,86</b>
<b>France</b>						
FR0013154028	France 1.75% 15-25.05.66 /oat	100.000	EUR	144.591	146.666	1,18
				<b>144.591</b>	<b>146.666</b>	<b>1,18</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
XS1550975079	Barclays 3.125% 17-17.01.24	100.000	GBP	133.096	121.175	0,97
XS1823595647	Hsbc Hldg 2.175% 18-27.06.23	200.000	GBP	264.493	243.667	1,95
XS1788982996	Lloyds Bk 1.75% 18-07.09.28	100.000	EUR	110.971	102.873	0,83
				<b>508.560</b>	<b>467.715</b>	<b>3,75</b>
<b>Irlande</b>						
XS1288894691	Swisscom Ag 1.75% 15-15.09.25	100.000	EUR	124.999	115.271	0,93
				<b>124.999</b>	<b>115.271</b>	<b>0,93</b>
<b>Luxembourg</b>						
XS1964701822	Aroundtown 5.375% 19-21.03.29	200.000	USD	198.430	223.344	1,79
				<b>198.430</b>	<b>223.344</b>	<b>1,79</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Espagne</b>						
US05971KAC36	Santander 3.306% 19-27.06.29	200.000	USD	202.250	193.218	1,55
US87938WAT09	Telefonica 4.103% 17-08.03.27	100.000	USD	98.000	102.967	0,83
				<b>300.250</b>	<b>296.185</b>	<b>2,38</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US06051GHV41	Bac 3.194% 19-23.07.30	100.000	USD	104.105	102.563	0,82
US278642AV58	Ebay 1.90% 20-11.03.25	50.000	USD	49.891	47.372	0,38
US458182CZ31	Iadb 4.4% 06-26.01.26	100.000	CAD	84.674	83.084	0,67
US91324PDS83	Unh Grp 2.875% 19-15.08.29	100.000	USD	99.973	104.897	0,84
				<b>338.643</b>	<b>337.916</b>	<b>2,71</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>1.908.508</b>	<b>1.881.705</b>	<b>15,11</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	563	GBP	3.996	3.887	0,03
				<b>3.996</b>	<b>3.887</b>	<b>0,03</b>
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	1.258	CAD	7.425	7.893	0,06
				<b>7.425</b>	<b>7.893</b>	<b>0,06</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US03027X1000	American Tower Corp	30	USD	5.979	6.533	0,05
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	1.046	USD	6.225	5.303	0,04
US1011211018	Boston Properties	41	USD	3.726	3.781	0,03
US22822V1017	Crown Castle International Shs	153	USD	22.045	22.093	0,19
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	732	USD	22.927	17.422	0,14
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	47	USD	5.861	4.842	0,04
US7561091049	Realty Income Corp	259	USD	20.586	12.914	0,10
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	1.075	USD	28.158	17.888	0,14
US92936U1097	Wp Carey Inc Reit	103	USD	5.912	5.982	0,05
				<b>121.419</b>	<b>96.758</b>	<b>0,78</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>132.840</b>	<b>108.538</b>	<b>0,87</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>7.127.138</b>	<b>6.537.260</b>	<b>52,49</b>
<b>Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>						
<b>Obligations</b>						
<b>Canada</b>						
CA68333ZAA53	Ontario 2.9% 17-02.06.49	150.000	CAD	126.078	113.001	0,91

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CA74814ZEW91	Quebec Prov 3.5% 15-01.12.48	100.000	CAD	93.889	84.061	0,67
				<b>219.967</b>	<b>197.062</b>	<b>1,58</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>219.967</b>	<b>197.062</b>	<b>1,58</b>
<b>Total - Valeurs mobilières et instruments du marché monétaire, qui ne sont ni cotés à une bourse, ni négociés sur un marché réglementé</b>				<b>219.967</b>	<b>197.062</b>	<b>1,58</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00B3ZBQ888	Gam Star Cat Bd -inst- Usd	48.380	USD	527.664	517.700	4,16
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	17.100	USD	116.745	113.630	0,91
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	8.379	USD	419.882	397.667	3,19
				<b>1.064.291</b>	<b>1.028.997</b>	<b>8,26</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	7.157	USD	940.945	803.588	6,45
LU1637934230	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nt	10.662	USD	1.106.983	1.101.171	8,84
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	6.823	USD	739.908	612.296	4,92
LU1900092039	Swisscanto (lu) Equity Fund Systematic Responsible Eurozone Nt	6.349	EUR	715.033	586.714	4,71
LU1900092971	Swisscanto (lu) Equity Fund Systematic Responsible Japan Nt Chf	6.712	CHF	657.711	615.807	4,94
				<b>4.160.580</b>	<b>3.719.576</b>	<b>29,86</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>5.224.871</b>	<b>4.748.573</b>	<b>38,12</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>5.224.871</b>	<b>4.748.573</b>	<b>38,12</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>12.571.976</b>	<b>11.482.895</b>	<b>92,19</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Luxembourg	31,65	Fonds d'investissements	38,18
Etats-Unis d'Amérique	23,37	Banques et autres institutions financières	10,49
Suisse	10,13	Pharmacie et cosmétique	5,49
Irlande	10,02	Obligations d'Etats et de villes étrangers	4,27
Royaume-Uni	6,11	Internet Software	3,47
Canada	4,29	Assurances	3,46
Espagne	2,38	Transmission de nouvelles	2,74
Belgique	1,51	Construction, matériel de construction	2,49
France	1,18	Holdings et sociétés financières	2,49
Allemagne	0,86	Sociétés immobilières	2,49
Bermudes	0,45	Alimentation, boissons	2,27
Jersey	0,15	Commerce de détail et grands magasins	2,24
Curacao	0,09	Articles de bureau et ordinateurs	1,55
	<b>92,19</b>	Pétrole	1,35
		Santé, éducation et services sociaux	1,32
		Mécanique, outillage	1,18
		Electrotechnique, électronique	1,05
		Services divers	0,84
		Energie et service des eaux	0,76
		Supranational	0,67
		Arts graphiques et maisons d'édition	0,56
		Biotechnologie	0,45
		Biens de consommation divers	0,40
		Métaux non ferreux	0,25
		Chimie	0,24
		Textile et habillement	0,23
		Papier et bois	0,20
		Industrie aéronautique et spatiale	0,20
		Circulation et transport	0,18
		Service d'environnement et de recyclage	0,16
		Métaux et pierres précieuses	0,14
		Maisons de commerce diverses	0,10
		Gastronomie	0,10
		Véhicules routiers	0,08
		Mines, aciéries	0,05
		Agriculture et pêche	0,05
			<b>92,19</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>						
<b>Actions</b>						
<b>Belgique</b>						
BE0003826436	Telenet Group Holding	1.841	EUR	78.391	53.631	0,03
BE0003739530	Ucb	2.078	EUR	196.178	174.282	0,12
				<b>274.569</b>	<b>227.913</b>	<b>0,15</b>
<b>Bermudes</b>						
BMG169621056	Bunge Ltd	735	USD	26.343	29.178	0,02
BMG475671050	Ihs Markit Ltd	2.941	USD	232.445	170.734	0,11
				<b>258.788</b>	<b>199.912</b>	<b>0,13</b>
<b>Curacao</b>						
AN8068571086	Schlumberger Ltd	2.200	USD	31.428	28.715	0,02
				<b>31.428</b>	<b>28.715</b>	<b>0,02</b>
<b>Allemagne</b>						
DE000A1EWWW0	Adidas Ag	886	EUR	269.787	193.673	0,12
DE0008404005	Allianz Se/nam.vinkuliert	2.077	EUR	447.193	345.926	0,22
DE0005200000	Beiersdorf A.g.	267	EUR	27.071	26.237	0,02
DE0005313704	Carl Zeiss Meditec Ag	1.002	EUR	113.640	93.984	0,06
DE0005439004	Continental Ag	430	EUR	30.545	29.951	0,02
DE0005140008	Deutsche Bank Ag /nam.	6.382	EUR	43.515	40.442	0,03
DE0005810055	Deutsche Boerse Ag /nam.	1.647	EUR	235.911	218.566	0,14
DE0005552004	Deutsche Post Ag	6.343	EUR	240.604	166.835	0,11
DE0005557508	Deutsche Telekom /nam.	7.488	EUR	95.159	93.917	0,06
DE000EVNK013	Evonik Industr -shs-	7.131	EUR	201.072	144.371	0,09
DE0006048432	Henkel / Vorzug	1.334	EUR	101.349	103.668	0,07
DE0006048408	Henkel Ag & Co. Kгаа	1.032	EUR	68.692	73.790	0,05
DE000KGX8881	Kion Group	554	EUR	23.417	23.197	0,01
DE0008430026	Muenchener Rueckvers/namensakt	1.177	EUR	261.003	230.043	0,15
DE0007164600	Sap Se	2.236	EUR	234.624	244.031	0,16
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	2.067	EUR	233.102	170.002	0,11
DE000A1J5RX9	Telefonica Deutschland Hold	53.800	EUR	211.630	129.026	0,08
DE000UNSE018	Uniper Se	3.685	EUR	105.688	87.985	0,06
				<b>2.944.002</b>	<b>2.415.644</b>	<b>1,56</b>
<b>Finlande</b>						
FI0009007132	Fortum Corporation	2.822	EUR	39.362	40.071	0,03
FI0009007835	Metso Corp	6.226	EUR	221.828	143.565	0,09
FI0009000681	Nokia Oy	16.056	EUR	48.399	48.904	0,03
				<b>309.589</b>	<b>232.540</b>	<b>0,15</b>
<b>France</b>						
FR0000120073	Air Liquide	2.376	EUR	300.565	294.246	0,19
FR0000120628	Axa	14.023	EUR	380.246	235.043	0,15

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
FR0000131104	Bnp Paribas	5.044	EUR	160.866	147.314	0,09
FR0000120644	Danone.	1.881	EUR	112.221	117.101	0,08
FR0000130452	Eiffage Sa	2.176	EUR	237.545	149.004	0,10
FR0000121667	Essilorluxott --- Act.	1.833	EUR	275.950	191.252	0,12
FR0010221234	Eutelsat Communications Paris	9.503	EUR	185.708	96.106	0,06
FR0000121485	Kering Sa	409	EUR	257.269	206.642	0,13
FR0000120321	L Oreal	612	EUR	177.929	155.220	0,10
FR0010307819	Legrand Holding Act.prov.opo	1.022	EUR	62.646	63.451	0,04
FR0000121261	Michelin B /nom.	1.122	EUR	95.852	96.556	0,06
FR0000125007	Saint-gobain	7.705	EUR	317.299	181.309	0,12
FR0000120578	Sanofi	3.137	EUR	258.120	266.897	0,17
FR0000121972	Schneider Electric Se	3.168	EUR	347.072	264.287	0,17
FR0010613471	Suez Environnement Cie	11.823	EUR	172.271	116.431	0,07
FR0000120271	Total Sa	10.985	EUR	630.603	412.724	0,28
FR0000054470	Ubisoft Entertainment	347	EUR	23.011	24.749	0,02
FR0000124141	Veolia Environnement	7.049	EUR	184.220	145.742	0,09
				<b>4.179.393</b>	<b>3.164.074</b>	<b>2,04</b>
	<b>Royaume-Uni</b>					
GB00B02J6398	Admiral Group Plc	2.853	GBP	74.739	76.328	0,05
GB0000456144	Antofagasta Plc	2.885	GBP	24.695	26.755	0,02
GB0000536739	Ashtead Group Plc	4.312	GBP	128.134	91.332	0,06
GB0006731235	Associated British Foods Plc	7.048	GBP	228.822	153.384	0,10
GB0009895292	Astrazeneca Plc	3.011	GBP	240.881	260.666	0,17
GB0031348658	Barclays Plc	89.896	GBP	109.965	101.497	0,07
GB0007980591	Bp Plc	100.744	GBP	450.873	416.015	0,26
GB0031743007	Burberry Group Plc	10.379	GBP	273.672	164.925	0,11
GB00B033F229	Centrica Plc	163.356	GBP	307.901	74.629	0,05
GB00BD6K4575	Compass Group Plc	5.271	GBP	68.208	79.931	0,05
GB0009252882	Glaxosmithkline Plc	21.166	GBP	444.161	384.606	0,24
GB0005405286	Hsbc Holdings Plc	37.095	GBP	278.160	202.157	0,13
GB00B0SWJX34	Lse Group	393	GBP	33.485	34.324	0,02
GB0031274896	Marks And Spencer /new	50.605	GBP	119.073	60.250	0,04
GB00BZ1G4322	Melrose Industries Plc	99.452	GBP	230.970	109.172	0,07
GB00BJ1F4N75	Micro Focus International Plc	11.638	GBP	117.992	55.849	0,04
GB0032089863	Next Plc	1.073	GBP	81.950	52.419	0,03
GB0006825383	Persimmon Plc	3.450	GBP	128.343	79.324	0,05
GB00B24CGK77	Reckitt Benckiser Group Plc	1.631	GBP	108.451	120.339	0,08
GB00B2B0DG97	Relx Plc	12.497	GBP	314.903	259.676	0,17
GB0007188757	Rio Tinto Plc /reg.	6.429	GBP	283.999	286.806	0,18
GB00B8C3BL03	Sage Grp	4.953	GBP	33.656	35.166	0,02
GB0009223206	Smith And Nephew Plc	3.850	GBP	62.998	66.258	0,04
GB00B1WY2338	Smiths Group Plc	2.911	GBP	37.652	42.816	0,03
GB0004082847	Standard Chartered Plc	19.701	GBP	107.852	105.367	0,07
GB0008782301	Taylor Wimpey Plc	105.521	GBP	192.366	148.749	0,10
GB0008847096	Tesco Plc	30.951	GBP	79.279	84.959	0,05
GB00B10RZP78	Unilever Plc	5.642	GBP	337.229	275.862	0,18
GB00BH4HKS39	Vodafone Group Plc	169.910	GBP	321.784	230.343	0,15
				<b>5.222.193</b>	<b>4.079.904</b>	<b>2,63</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Irlande</b>						
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	1.366	USD	208.050	215.776	0,15
IE00BY9D5467	Allergan Plc	329	USD	54.403	56.375	0,04
IE00B8KQN827	Eaton Corporation Public Ltd	2.267	USD	175.057	170.408	0,11
IE00BY7QL619	Johnson Ctr Int Shs	4.387	USD	173.964	114.436	0,07
IE00BTN1Y115	Medtronic Holdings Limited	2.205	USD	206.990	192.394	0,12
IE00BLS09M33	Pentair Plc	1.158	USD	32.870	33.344	0,02
IE00B1RR8406	Smurfit Kappa Group Plc	5.793	EUR	205.267	158.181	0,10
				<b>1.056.601</b>	<b>940.914</b>	<b>0,61</b>
<b>Italie</b>						
IT0003128367	Enel	34.748	EUR	197.863	233.845	0,16
IT0003132476	Eni Spa Roma	19.572	EUR	339.688	191.578	0,12
NL0011585146	Ferrari N.v.	557	EUR	82.592	83.704	0,05
IT0003796171	Poste Italiane Spa	5.777	EUR	64.246	47.348	0,03
				<b>684.389</b>	<b>556.475</b>	<b>0,36</b>
<b>Japon</b>						
JP3102000001	Aisin Seiki Co Ltd	2.600	JPY	65.063	62.078	0,04
JP3119600009	Ajinomoto Co. Inc	3.500	JPY	57.453	63.067	0,04
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	15.200	JPY	226.888	227.641	0,15
JP3220580009	Calbee Inc	900	JPY	21.850	23.562	0,02
JP3242800005	Canon Inc.	5.800	JPY	126.247	122.627	0,08
JP3566800003	Central Japan Railway Co	900	JPY	143.428	139.708	0,09
JP3511800009	Chiba Bank	31.500	JPY	172.659	133.537	0,09
JP3493800001	Dai Nippon Printing Co.ltd	7.900	JPY	198.988	162.920	0,10
JP3485800001	Daicel --- Shs	18.100	JPY	187.238	127.993	0,08
JP3551500006	Denso Corp	6.500	JPY	264.870	203.373	0,13
JP3160400002	Eisai Co.ltd	1.200	JPY	80.004	85.298	0,05
JP3802600001	Familymart Co.. Ltd.	6.700	JPY	117.599	116.375	0,07
JP3802400006	Fanuc Corp --- Shs	300	JPY	40.473	39.404	0,03
JP3802300008	Fast Retailing Co Ltd	200	JPY	88.577	79.211	0,05
JP3820000002	Fuji Electric Co Ltd	4.800	JPY	147.644	105.356	0,07
JP3818000006	Fujitsu Ltd	1.600	JPY	139.497	139.887	0,09
JP3766550002	Hakuhodo Dy Hld Inc	3.800	JPY	38.804	37.123	0,02
JP3678800008	Hitachi Hi-tec Rg Registered Shs	1.600	JPY	94.858	114.434	0,07
JP3788600009	Hitachi Ltd	8.500	JPY	302.116	239.439	0,15
JP3854600008	Honda Motor Co.ltd	7.200	JPY	163.990	156.809	0,10
JP3837800006	Hoya Corp	900	JPY	70.956	74.210	0,05
JP3294460005	Inpex Corp	30.400	JPY	288.112	165.874	0,11
JP3143900003	Itochu Techno-solutions	3.900	JPY	102.781	107.833	0,07
JP3705200008	Japan Air Lines Co Jpy50	1.400	JPY	26.589	24.970	0,02
JP3386030005	Jfe Holdings Inc	4.100	JPY	30.456	25.833	0,02
JP3205800000	Kao Corp.	3.200	JPY	261.424	253.245	0,16
JP3496400007	Kddi Corp.	6.300	JPY	179.337	180.120	0,12
JP3266400005	Kubota Corp	3.000	JPY	34.652	37.145	0,02
JP3982100004	Lawson Inc	2.600	JPY	142.304	138.184	0,09
JP3626800001	Lixil Group Shs	13.800	JPY	233.141	166.354	0,11
JP3899600005	Mitsubishi Estate Co.	10.500	JPY	156.270	150.100	0,10

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
JP3499800005	Mitsubishi Ufj Lease & Fin	28.100	JPY	168.770	133.983	0,09
JP3893200000	Mitsui Fudosan Co	2.900	JPY	49.271	48.617	0,03
JP3885780001	Mizuho Financial Groupinc	83.400	JPY	98.712	92.388	0,06
JP3890310000	Ms&ad Insurance Group Holdings	6.500	JPY	212.920	176.226	0,11
JP3914400001	Murata Manufactur Co Ltd	1.700	JPY	82.246	83.373	0,05
JP3756600007	Nintendo Co.ltd	500	JPY	189.373	186.466	0,12
JP3743000006	Nippon Meat Packers	2.300	JPY	88.264	77.611	0,05
JP3749400002	Nippon Paint Holdings Co.ltd.	1.600	JPY	81.956	81.165	0,05
JP3735400008	Nippon Tel&tel	8.300	JPY	201.969	191.589	0,12
JP3672400003	Nissan Motor Co.ltd	11.300	JPY	39.797	36.115	0,02
JP3676800000	Nisshin Seifun Group Inc	4.400	JPY	67.841	71.062	0,05
JP3684000007	Nitto Denko Corpo	3.800	JPY	215.211	164.328	0,11
JP3762900003	Nomura Real Estate Hdgs Inc	9.500	JPY	215.397	149.428	0,10
JP3165650007	Ntt Docomo Inc	8.400	JPY	219.130	254.238	0,16
JP3190000004	Obayashi Corp.	19.100	JPY	176.291	158.517	0,10
JP3201200007	Olympus Corp	11.200	JPY	133.443	156.794	0,10
JP3200450009	Orix Corp	9.700	JPY	119.025	113.061	0,07
JP3188220002	Otsuka Holdings Co Ltd	1.300	JPY	45.087	49.297	0,03
JP3866800000	Panasonic Corp	6.700	JPY	49.587	49.540	0,03
JP3855900001	Pola Orbis Holdings Inc	1.400	JPY	25.384	25.032	0,02
JP3970300004	Recruit Holdings Co.ltd.	3.100	JPY	84.570	77.684	0,05
JP3336000009	Santen Pharmaceutical	2.300	JPY	38.799	38.301	0,02
JP3419400001	Sekisui Chemical Co Ltd	5.700	JPY	98.171	73.207	0,05
JP3162770006	Sg Holdings Co. Ltd.	1.100	JPY	23.567	25.367	0,02
JP3371200001	Shin-etsu Chemical Co	2.600	JPY	228.173	250.037	0,16
JP3347200002	Shionogi & Co Ltd	1.100	JPY	48.650	52.419	0,03
JP3732000009	Softbank Corp.	1.700	JPY	21.181	20.942	0,01
JP3435000009	Sony Corp	6.300	JPY	415.393	362.554	0,24
JP3401400001	Sumitomo Chemical Co.ltd	14.700	JPY	42.465	42.292	0,03
JP3890350006	Sumitomo Mitsui Financ.gr	3.600	JPY	93.264	84.631	0,05
JP3892100003	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	5.800	JPY	204.490	162.394	0,10
JP3336600006	Sundrug Co Ltd	4.400	JPY	127.334	136.446	0,09
JP3336560002	Suntory B & F	3.900	JPY	140.057	142.787	0,09
JP3449020001	Taiheiyo Cement Corp. Tokyo	5.700	JPY	156.714	94.510	0,06
JP3463000004	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	3.400	JPY	99.860	100.803	0,06
JP3544000007	Teijin Ltd	7.100	JPY	134.761	116.450	0,07
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	5.100	JPY	274.066	226.259	0,15
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	1.200	JPY	254.524	218.919	0,14
JP3629000005	Toppan Printing Co.ltd	4.800	JPY	85.400	71.241	0,05
JP3592200004	Toshiba Corp	3.300	JPY	72.381	70.392	0,05
JP3595200001	Tosoh Corp	13.600	JPY	202.510	149.925	0,10
JP3633400001	Toyota Motor Corp	4.900	JPY	302.452	285.501	0,19
JP3933800009	Z Holdings Corporation	38.100	JPY	153.791	118.832	0,08
				<b>9.986.515</b>	<b>8.924.433</b>	<b>5,75</b>
	<b>Jersey</b>					
GB00B19NLV48	Experian Plc	3.948	GBP	104.257	106.618	0,07
JE00BJVNSS43	Ferguson Newco Plc	2.608	GBP	225.716	158.195	0,10
				<b>329.973</b>	<b>264.813</b>	<b>0,17</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Canada</b>						
CA0084741085	Agnico Eagle Mines Limited	2.106	CAD	85.038	80.427	0,05
CA0089118776	Air Canada Vt And Var Vt Shs	9.977	CAD	382.303	106.818	0,07
CA01626P4033	Aliment Couche Tard-vtg B	3.338	CAD	76.779	75.220	0,05
CA0467894006	Atco Ltd - CI I Non Voting	3.658	CAD	136.318	96.903	0,06
CA0641491075	Bank Of Nova Scotia	1.839	CAD	71.859	71.843	0,05
CA05534B7604	Bce Inc	4.216	CAD	173.027	165.449	0,11
CA1125851040	Brookfield Asset Mgmt -a-/Ltd	738	CAD	30.867	31.294	0,02
CA1363851017	Canadian Nat. Resources	17.954	CAD	550.206	234.938	0,15
CA1363751027	Canadian National Railway	1.364	CAD	98.684	102.020	0,07
CA13645T1003	Canadian Pacific Railway Co	165	CAD	33.718	34.832	0,02
CA1366812024	Canadian T.corp A N-vot.	1.912	CAD	207.180	110.398	0,07
CA1367178326	Canadian Utilit.ltd-a-n-vot	4.675	CAD	146.624	106.905	0,07
CA15135U1093	Cenovus Energy	42.633	CAD	407.178	82.305	0,05
CA12532H1047	Cgi Inc -a-	3.621	CAD	218.785	187.538	0,12
CA1254911003	Ci Financial Corp	14.091	CAD	236.509	133.814	0,09
CA2908761018	Emera Inc	2.471	CAD	85.187	93.224	0,06
CA2918434077	Empire Co Ltd -a-/non Voting	7.260	CAD	138.937	135.864	0,09
CA29250N1050	Enbridge Inc.	4.970	CAD	137.655	138.449	0,09
CA3359341052	First Quantum Minerals Ltd	5.688	CAD	27.642	27.800	0,02
CA4488112083	Hydro One Ltd	2.895	CAD	50.189	49.867	0,03
CA45075E1043	Ia Financial Corporation Inc	5.353	CAD	207.680	160.981	0,10
CA45823T1066	Intact Fin	940	CAD	76.445	77.720	0,05
CA4969024047	Kinross Gold Corp	10.596	CAD	48.166	40.696	0,03
CA49741E1007	Kirkland Lake Gold Ltd	3.169	CAD	100.750	89.291	0,06
CA5394811015	Loblaw Companies Ltd	3.096	CAD	127.554	152.686	0,10
CA5592224011	Magna International Inc	6.131	CAD	339.546	187.170	0,12
CA56501R1064	Manulife Financial Corp	22.030	CAD	415.421	264.615	0,16
CA6330671034	National Bank Of Canada	5.097	CAD	276.266	188.450	0,12
CA67077M1086	Nutrien Ltd	2.217	CAD	66.020	72.504	0,05
CA6837151068	Open Text Corp	2.319	CAD	73.347	77.574	0,05
CA70137T1057	Parkland Fuel Corp	11.002	CAD	393.687	185.550	0,12
CA7392391016	Power Corp.canada	11.883	CAD	275.503	182.879	0,12
CA7481932084	Quebecor Inc	6.261	CAD	152.975	132.405	0,09
CA76131D1033	Restaurant Brands Intl Inc	2.309	CAD	98.451	89.011	0,06
CA7800871021	Royal Bank Of Canada	4.048	CAD	281.118	239.867	0,14
CA82509L1076	Shopify Inc	249	CAD	107.831	99.801	0,06
CA8667961053	Sun Life Financial Inc	5.811	CAD	231.170	178.823	0,12
CA8849037095	Thomson Reuters Corp	517	CAD	30.439	33.696	0,02
CA8911605092	Toronto Dominion Bk	4.634	CAD	228.910	188.468	0,12
CA94106B1013	Waste Connections Inc	543	USD	37.972	40.717	0,03
CA92938W2022	Wsp Global Inc	661	CAD	33.074	35.910	0,02
				<b>6.897.010</b>	<b>4.784.722</b>	<b>3,08</b>
<b>Liechtenstein</b>						
LI0355147575	Liechtenst	2.490	CHF	142.287	134.460	0,09
				<b>142.287</b>	<b>134.460</b>	<b>0,09</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
<b>Pays-Bas</b>						
NL0012969182	Adyen B.v.	67	EUR	52.238	54.813	0,04
NL0000687663	Aercap Holdings Nv	4.089	USD	251.329	90.164	0,06
NL0010273215	Asml Holding Nv	1.154	EUR	299.543	297.035	0,19
NL0012059018	Exor N.v.	2.407	EUR	118.579	120.103	0,08
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.v.	6.883	EUR	155.642	155.536	0,10
NL0000009082	Koninklijke Kpn /eur 0.04	16.984	EUR	50.569	39.235	0,03
NL0000009538	Koninklijke Philips Nv/eur 0.2	6.033	EUR	244.183	236.437	0,15
NL0000226223	Stmicroelectronics Nv	2.352	EUR	48.499	49.628	0,03
NL0000388619	Unilever Nv.	5.382	EUR	308.548	256.006	0,16
				<b>1.529.130</b>	<b>1.298.957</b>	<b>0,84</b>
<b>Portugal</b>						
PTEDP0AM0009	Edp-energias De Portugal Sa	16.845	EUR	60.266	65.418	0,04
PTGAL0AM0009	Galp Energia Sgps Sa -b- Shrs	3.886	EUR	63.899	42.885	0,03
				<b>124.165</b>	<b>108.303</b>	<b>0,07</b>
<b>Suisse</b>						
CH0012221716	Abb	104.530	CHF	1.463.159	1.777.533	1,14
CH0012138605	Adecco Group Sa /act.nom.	18.763	CHF	1.322.174	715.621	0,46
CH0432492467	Alcon Inc.	16.112	CHF	738.343	794.805	0,51
CH0011339204	Ascom Holding Ag /nam.	28.673	CHF	467.830	156.268	0,10
CH0012410517	Baloise Holding/namen	6.204	CHF	926.718	787.288	0,51
CH0009002962	Barry Callebaut Ag /nam.	322	CHF	590.858	624.680	0,40
CH0001503199	Belimo Holding Ag /nam.	138	CHF	567.824	863.880	0,56
CH0198251305	Coca-cola Hbc	2.014	GBP	40.474	41.970	0,03
CH0012138530	Credit Suisse Group /nom.	166.939	CHF	2.882.520	1.335.512	0,86
CH0001752309	Fischer Georg Ag/nam.	639	CHF	810.177	427.491	0,28
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *opr*	459	CHF	654.059	537.489	0,35
CH0114405324	Garmin	2.000	USD	182.333	145.055	0,09
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	2.592	CHF	882.473	1.104.192	0,71
CH0010645932	Givaudan Sa /reg.	338	CHF	730.034	1.012.310	0,65
CH0008012236	Gurit Holding Ag. Wattwil Sg	290	CHF	261.138	334.080	0,22
CH0023868554	Implenia Ag	4.213	CHF	333.514	144.085	0,09
CH0011029946	Inficon Holding /namenakt.	748	CHF	454.231	471.240	0,30
CH0012214059	Lafargeholcim N Namen-akt.	27.379	CHF	1.447.212	968.121	0,62
CH0371153492	Landis+gyr Group Ltd	6.375	CHF	476.978	424.575	0,27
CH0108503795	Meyer Burger	171.354	CHF	291.367	26.406	0,02
CH0038863350	Nestle / Act Nom	101.974	CHF	5.308.046	10.141.313	6,53
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	101.903	CHF	6.822.454	8.136.955	5,24
CH0012032048	Roche Holding Ag /genussschein	31.502	CHF	6.793.911	9.893.202	6,37
CH0024638196	Schindler Holding/partic	4.579	CHF	966.145	972.580	0,63
CH0010754924	Schweiter Technologies *opr*	405	CHF	461.839	380.295	0,24
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	67.265	CHF	695.549	973.997	0,63
CH0418792922	Sika Ltd	5.341	CHF	679.483	854.293	0,55
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	5.388	CHF	831.281	939.667	0,61
CH0002178181	Stadler Rail Ag	5.047	CHF	191.786	225.601	0,15
CH0126881561	Swiss Re-namen	26.117	CHF	2.330.881	1.947.284	1,25
CH0008742519	Swisscom /nam.	2.933	CHF	1.491.147	1.525.747	0,98

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0012255144	The Swatch Group Ag/nam.	7.780	CHF	587.269	296.262	0,19
CH0244767585	Ubs Group Ag	228.151	CHF	5.989.076	2.063.854	1,33
CH0311864901	Vat Group Ltd	3.484	CHF	414.478	466.856	0,30
CH0012335540	Vontobel Holding Ag /nam.	809	CHF	46.091	38.508	0,02
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	8.720	CHF	2.461.240	2.994.448	1,93
				<b>51.594.092</b>	<b>54.543.463</b>	<b>35,12</b>
	<b>Espagne</b>					
ES0105046009	Aena Sme Sa	1.061	EUR	204.095	112.100	0,07
ES0113211835	Bco Bilbao Viz.argentaria/nam.	44.535	EUR	154.046	137.846	0,09
ES0130670112	Endesa Sa	11.813	EUR	306.499	244.178	0,15
ES0144580Y14	Iberdrola Sa	7.784	EUR	77.088	74.242	0,05
ES0148396007	Inditex	4.836	EUR	120.454	121.473	0,08
ES0173516115	Repsol Sa	22.858	EUR	352.778	202.193	0,13
				<b>1.214.960</b>	<b>892.032</b>	<b>0,57</b>
	<b>Etats-Unis d'Amérique</b>					
US0028241000	Abbott Laboratories Inc	3.061	USD	198.449	233.706	0,15
US00287Y1091	Abbvie Inc	2.668	USD	233.008	196.679	0,13
US00507V1098	Activision Blizzard Inc	550	USD	28.452	31.652	0,02
US00724F1012	Adobe Inc	90	USD	26.939	27.712	0,02
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc	693	USD	30.262	30.495	0,02
US00130H1059	Aes Corp.	8.166	USD	82.975	107.454	0,07
US00971T1016	Akamai Technologies Inc	1.038	USD	75.416	91.885	0,06
US0171751003	Alleghany Corp (del)	144	USD	113.148	76.957	0,05
US0200021014	Allstate Corp	810	USD	88.718	71.890	0,05
US02005N1000	Ally Financial Inc	4.085	USD	109.560	57.034	0,04
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	238	USD	256.535	267.570	0,17
US02079K1079	Alphabet Inc -c-	375	USD	321.731	421.903	0,26
US0231351067	Amazon Com Inc	361	USD	494.251	681.008	0,43
US0258161092	American Express Co.	1.601	USD	173.565	132.614	0,09
US03076C1062	Ameriprise Financ. /wh.i	816	USD	130.423	80.910	0,05
US0311621009	Amgen Inc	995	USD	204.369	195.171	0,13
US0378331005	Apple Inc	4.015	USD	542.049	987.843	0,63
US0382221051	Applied Materials Inc	3.347	USD	204.010	148.383	0,10
US03965L1008	Arconic Inc	5.090	USD	141.505	79.093	0,05
US04621X1081	Assurant Inc	1.058	USD	147.167	106.554	0,07
US00206R1023	At & T	10.432	USD	365.020	294.225	0,19
US0605051046	Bank Of America Corp	4.166	USD	86.008	85.574	0,06
US0718131099	Baxter Intl Inc	798	USD	58.937	62.687	0,04
US0865161014	Best Buy Co Inc.	1.016	USD	74.679	56.033	0,04
US09062X1037	Biogen Inc	151	USD	42.105	46.223	0,03
US1011371077	Boston Scientific Corp.	1.782	USD	52.168	56.260	0,04
US1101221083	Bristol Myers Squibb Co	2.221	USD	135.178	119.781	0,08
US1491231015	Caterpillar Inc.	354	USD	36.255	39.745	0,03
US12504L1098	Cbre Group -a-	3.757	USD	184.382	137.079	0,09
US12508E1010	Cdk Global Inc	728	USD	24.332	23.139	0,01
US1567821046	Cerner Corp	2.470	USD	174.731	150.537	0,10
US1667641005	Chevron Corporation	1.377	USD	93.329	96.540	0,06
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	6.625	USD	188.483	251.978	0,16

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US1729674242	Citigroup Inc	5.157	USD	328.455	210.164	0,14
US1746101054	Citizens Financial Group Inc	2.212	USD	77.169	40.258	0,03
US1890541097	Clorox Co *opa*	203	USD	32.904	34.029	0,02
US1912161007	Coca-cola Co.	6.619	USD	388.388	283.387	0,18
US1941621039	Colgate-palmolive Co.	929	USD	54.439	59.648	0,04
US20030N1019	Comcast Corp/-a-	2.073	USD	68.091	68.957	0,04
US20825C1045	Conocophillips	5.712	USD	311.392	170.221	0,11
US22160K1051	Costco Wholesale Corp	87	USD	23.908	24.001	0,02
US2310211063	Cummins Inc	449	USD	56.132	58.787	0,04
US1266501006	Cvs Health Corp	415	USD	21.781	23.823	0,02
US2566771059	Dollar General Corporation	262	USD	31.712	38.281	0,02
US2600031080	Dover Corp.	2.053	USD	188.361	166.737	0,11
US26441C2044	Duke Energy	1.493	USD	109.138	116.835	0,08
US2774321002	Eastman Chemical Co	479	USD	21.831	21.588	0,01
US28176E1082	Edwards Lifesciences	137	USD	25.594	25.002	0,02
US2855121099	Electronic Arts	853	USD	91.522	82.672	0,05
US29452E1010	Equitable Hldg Rg	9.433	USD	219.131	131.884	0,08
US30231G1022	Exxon Mobil Corp	835	USD	30.466	30.676	0,02
US30303M1027	Facebook Inc -a-	2.055	USD	351.949	331.651	0,21
US34354P1057	Flowserve Corp	1.095	USD	24.642	25.311	0,02
US3156161024	F5 Networks Inc.	1.152	USD	150.297	118.852	0,08
US3696041033	General Electric Co	8.733	USD	64.599	67.090	0,04
US3703341046	General Mills Inc	1.835	USD	97.595	93.691	0,06
US3755581036	Gilead Sciences Inc.	787	USD	53.641	56.927	0,04
US37959E1029	Globe Life Inc	510	USD	33.843	35.514	0,02
US38141G1040	Goldman Sachs Group Inc.	416	USD	63.143	62.223	0,04
US4361061082	Hollyfrontier Corp	1.791	USD	96.077	42.473	0,03
US4364401012	Hologic Inc	869	USD	27.430	29.512	0,02
US4370761029	Home Depot Inc.	729	USD	129.647	131.695	0,08
US4592001014	Ibm Corp	1.035	USD	107.194	111.087	0,07
US4581401001	Intel Corp.	3.249	USD	185.669	170.130	0,11
US4612021034	Intuit	367	USD	83.517	81.671	0,05
US46120E6023	Intuitive Surgical Inc	85	USD	38.283	40.727	0,03
US4781601046	Johnson & Johnson	3.466	USD	474.955	439.747	0,27
US48020Q1076	Jones Lang Lasalle	545	USD	75.237	53.248	0,03
US4851703029	Kansas City Southern	630	USD	90.302	77.523	0,05
US4943681035	Kimberly Clark Corp	1.333	USD	180.411	164.920	0,11
US5010441013	Kroger Co.	854	USD	23.346	24.888	0,02
US5128071082	Lam Research Corp	628	USD	150.317	145.829	0,09
US5312294094	Liberty Media Corp	2.487	USD	124.284	76.256	0,05
US5324571083	Lilly (eli) & Co	619	USD	73.854	83.081	0,05
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	1.317	USD	151.029	109.650	0,07
US57636Q1040	Mastercard Inc. Shs-a-	1.354	USD	351.036	316.459	0,20
US58155Q1031	Mckesson Corp	425	USD	57.431	55.620	0,04
US58933Y1055	Merck	3.848	USD	260.141	286.458	0,18
US59156R1086	Metlife Inc	5.889	USD	274.840	174.185	0,11
US5951121038	Micron Technology Inc	548	USD	22.788	22.301	0,01
US5949181045	Microsoft Corp.	6.919	USD	515.347	1.055.786	0,67
US6092071058	Mondelez International Inc Wi	1.802	USD	81.299	87.316	0,06
US61174X1090	Monster Beverage Corp	2.554	USD	176.664	139.025	0,09

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US6153691059	Moody S Corp	855	USD	211.106	174.965	0,11
US6200763075	Motorola Soltn/ex-distr	295	USD	38.580	37.939	0,02
US6516391066	Newmont Rg Registered Shs	1.500	USD	69.773	65.716	0,04
US6541061031	Nike Inc B	1.326	USD	102.509	106.153	0,07
US65473P1057	Nisource Inc	3.481	USD	77.758	84.100	0,05
US67066G1040	Nvidia Corp.	544	USD	130.737	138.745	0,09
US6907421019	Owens Corning Inc	3.175	USD	206.027	119.223	0,08
US7010941042	Parker-hannifin	651	USD	80.596	81.714	0,05
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	639	USD	73.708	59.193	0,04
US7134481081	Pepsico Inc	890	USD	111.396	103.420	0,07
US7170811035	Pfizer Inc.	3.878	USD	112.884	122.471	0,08
US7512121010	Polo Ralph Lauren	838	USD	88.647	54.186	0,03
US6935061076	Ppg Industries Inc.	891	USD	74.722	72.071	0,05
US69351T1060	Ppl Corp	3.878	USD	84.350	92.603	0,06
US7458671010	Pultegroup Inc	8.283	USD	322.195	178.877	0,12
US74736K1016	Qorvo Inc	735	USD	68.228	57.340	0,04
US7475251036	Qualcomm Inc.	2.388	USD	206.673	156.306	0,10
US75886F1075	Regeneron Pharma. Inc.	80	USD	33.641	37.796	0,02
US7591EP1005	Regions Financial Corp	16.325	USD	291.582	141.683	0,09
US7607591002	Republic Services Inc.	1.933	USD	149.144	140.383	0,09
US79466L3024	Salesforce Com Inc	537	USD	77.269	74.808	0,05
US8330341012	Snap-on Inc	529	USD	82.230	55.698	0,04
US78409V1044	S&p Global Shs	811	USD	209.781	192.287	0,12
US87165B1035	Synchrony Financial	5.905	USD	191.421	91.928	0,06
US8716071076	Synopsys Inc.	317	USD	37.630	39.502	0,03
US8718291078	Sysco Corp.	2.616	USD	178.615	115.495	0,07
US87612E1064	Target Corp	1.213	USD	83.034	109.113	0,07
US8725401090	Tjx Companies Inc	3.717	USD	217.448	171.943	0,11
US89400J1079	Transunion	610	USD	39.255	39.060	0,03
US9024941034	Tyson Foods Inc.-a-	953	USD	71.937	53.361	0,03
US9078181081	Union Pacific Corp.	776	USD	100.915	105.896	0,07
US9113631090	United Rentals Inc.	731	USD	92.811	72.779	0,05
US9130171096	United Technologies Corp	2.147	USD	202.069	195.955	0,13
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	1.269	USD	202.460	306.194	0,20
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	226	USD	46.457	52.032	0,03
US92826C8394	Visa Inc -a	2.208	USD	367.856	344.209	0,22
US9285634021	Vmware Inc	221	USD	25.127	25.895	0,02
US9297401088	Wabtec Corp	626	USD	28.604	29.152	0,02
US2546871060	Walt Disney	714	USD	70.371	66.734	0,04
US9633201069	Whirlpool Corp.	721	USD	102.896	59.854	0,04
US9884981013	Yum Brands Shs	895	USD	63.813	59.344	0,04
US88579Y1010	3m Co	282	USD	36.295	37.247	0,02
				<b>16.851.910</b>	<b>16.067.480</b>	<b>10,34</b>
<b>Total - Actions</b>				<b>103.630.994</b>	<b>98.864.754</b>	<b>63,68</b>
<b>Obligations</b>						
	<b>Chili</b>					
CH0496632628	Bc Sant Cl 0.135% 19-29.08.29	500.000	CHF	499.500	395.000	0,25

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
CH0465767785	Bc Sant Cl 0.384% 19-27.09.24	1.000.000	CHF	1.000.000	919.250	0,60
				<b>1.499.500</b>	<b>1.314.250</b>	<b>0,85</b>
<b>Allemagne</b>						
CH0479514272	Dt Bahn Fin 0.10% 19-19.06.29	520.000	CHF	520.260	500.630	0,32
				<b>520.260</b>	<b>500.630</b>	<b>0,32</b>
<b>France</b>						
CH0479514264	Bfcm 0.2% 19-12.06.26	1.000.000	CHF	1.000.170	967.750	0,62
				<b>1.000.170</b>	<b>967.750</b>	<b>0,62</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
US06738EAU91	Barclays 4.337% 17-10.01.28	1.000.000	USD	1.078.846	991.594	0,64
CH0461239094	Bnz Intl Ln 0.111% 20-24.07.28	1.000.000	CHF	1.000.000	934.250	0,60
CH0310175515	Macqu Bk Ln 0.75% 16-05.02.24	500.000	CHF	512.475	488.125	0,31
				<b>2.591.321</b>	<b>2.413.969</b>	<b>1,55</b>
<b>Honduras</b>						
CH0398677713	Cabei 0.314% 18-05.09.24	1.500.000	CHF	1.501.950	1.491.750	0,96
				<b>1.501.950</b>	<b>1.491.750</b>	<b>0,96</b>
<b>Irlande</b>						
XS2076155105	Abbott Il F 0.375% 19-19.11.27	150.000	EUR	161.887	147.076	0,09
				<b>161.887</b>	<b>147.076</b>	<b>0,09</b>
<b>Canada</b>						
US29250NBA28	Enbridge 4.0% 19-15.11.49	50.000	USD	48.901	42.217	0,03
CA683234VR64	Ontario 5.6% 04-2.6.35 Dmtn119	700.000	CAD	758.398	673.146	0,43
XS1989375412	Rbc 0.25% 19-02.05.24	500.000	EUR	549.796	504.043	0,32
US89114QCB23	Tor Dom Bk 3.25% 19-11.03.24	1.000.000	USD	1.029.272	1.011.215	0,66
				<b>2.386.367</b>	<b>2.230.621</b>	<b>1,44</b>
<b>Luxembourg</b>						
CH0398677689	Aroundtown 0.732% 18-30.01.25	1.000.000	CHF	986.849	950.750	0,61
				<b>986.849</b>	<b>950.750</b>	<b>0,61</b>
<b>Pays-Bas</b>						
CH0479514298	Coop Rabo 0.25% 19-25.11.27	400.000	CHF	400.500	368.500	0,24
				<b>400.500</b>	<b>368.500</b>	<b>0,24</b>
<b>Corée du Sud</b>						
CH0419040917	Hyucap 0.7325% 19-26.02.24	1.000.000	CHF	1.000.000	979.250	0,63
				<b>1.000.000</b>	<b>979.250</b>	<b>0,63</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US026874DH71	Aig 3.9% 16-01.04.26	1.000.000	USD	1.026.535	1.007.335	0,66
XS2079716937	Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	100.000	EUR	109.061	99.267	0,06
USU4034GAA14	Gusap Iii 4.25% 19-21.01.30	200.000	USD	195.640	172.452	0,11

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US609207AR65	Mondelez 3.625% 19-13.02.26	500.000	USD	515.673	507.134	0,33
CH0471297959	Ny Life Gbl 0.25% 19-18.10.27 Regs	1.000.000	CHF	1.003.480	958.500	0,62
				<b>2.850.389</b>	<b>2.744.688</b>	<b>1,78</b>
<b>Total - Obligations</b>				<b>14.899.193</b>	<b>14.109.234</b>	<b>9,09</b>
<b>Fonds immobiliers (REIT)</b>						
<b>France</b>						
FR0000064578	Covivio Act	1.682	EUR	198.523	91.695	0,06
				<b>198.523</b>	<b>91.695</b>	<b>0,06</b>
<b>Royaume-Uni</b>						
GB00BYW0PQ60	Land Sec /reit	9.132	GBP	101.475	61.002	0,04
				<b>101.475</b>	<b>61.002</b>	<b>0,04</b>
<b>Canada</b>						
CA4039254079	H R Real Estate Investment Trust	4.096	CAD	23.651	24.864	0,02
				<b>23.651</b>	<b>24.864</b>	<b>0,02</b>
<b>Etats-Unis d'Amérique</b>						
US0357104092	Annaly Capital Management Inc	7.050	USD	41.043	34.584	0,02
US46284V1017	Iron Mountain Reit Inc /reit	5.758	USD	177.114	132.593	0,09
US59522J1034	Mid-america Apartment Commun.	1.443	USD	181.731	143.848	0,08
US6819361006	Omega Healthcare Investors	5.781	USD	230.393	148.449	0,09
US8666741041	Sun Communities Inc	491	USD	72.441	59.312	0,04
US92276F1003	Ventas Inc.	2.803	USD	201.346	72.683	0,05
US9256521090	Vici Properties Inc Reit	1.747	USD	26.375	28.127	0,02
				<b>930.443</b>	<b>619.596</b>	<b>0,39</b>
<b>Total - Fonds immobiliers (REIT)</b>				<b>1.254.092</b>	<b>797.157</b>	<b>0,51</b>
<b>Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire</b>				<b>119.784.279</b>	<b>113.771.145</b>	<b>73,28</b>
<b>Parts de fonds</b>						
<b>Fonds de placement</b>						
<b>Irlande</b>						
IE00BVXBYN70	Gam St Chf -ins- /cap	575.585	CHF	5.986.117	6.040.764	3,89
IE00B43HR379	Ish Hlt Ca Plc Ac Ptg Etf Usd/c	300.035	USD	2.022.794	1.929.037	1,24
IE00B0M63730	Ishares Msci Ac Far East Ex-japan Ucits	111.249	USD	5.285.125	5.108.547	3,29
				<b>13.294.036</b>	<b>13.078.348</b>	<b>8,42</b>
<b>Luxembourg</b>						
LU0431993749	Jpmf Em Mkt Opp -i- Usd Cap	66.197	USD	6.583.242	7.191.414	4,63
LU1637934073	Swisscanto (lu) Bond Fund Global Credit Opportunities Nth Chf	34.965	CHF	3.367.515	3.302.129	2,13

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Etat du portefeuille-titres (suite)

au 31 mars 2020

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
LU0866272569	Swisscanto (lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	67.608	USD	7.493.353	5.870.265	3,78
				<b>17.444.110</b>	<b>16.363.808</b>	<b>10,54</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>30.738.146</b>	<b>29.442.156</b>	<b>18,96</b>
<b>Total - Parts de fonds</b>				<b>30.738.146</b>	<b>29.442.156</b>	<b>18,96</b>
<b>TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES</b>				<b>150.522.425</b>	<b>143.213.301</b>	<b>92,24</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

### Répartition géographique et économique du portefeuille-titres

au 31 mars 2020

(en pourcentage de l'actif net)

<b>Répartition géographique</b>	<b>%</b>	<b>Répartition économique</b>	<b>%</b>
Suisse	35,12	Fonds d'investissements	18,98
Etats-Unis d'Amérique	12,51	Pharmacie et cosmétique	14,81
Luxembourg	11,15	Alimentation, boissons	8,32
Irlande	9,12	Holdings et sociétés financières	7,38
Japon	5,75	Banques et autres institutions financières	6,54
Canada	4,54	Assurances	5,51
Royaume-Uni	4,22	Electrotechnique, électronique	4,17
France	2,72	Chimie	2,80
Allemagne	1,88	Construction, matériel de construction	2,73
Pays-Bas	1,08	Transmission de nouvelles	2,38
Honduras	0,96	Internet Software	2,27
Chili	0,85	Mécanique, outillage	1,84
Corée du Sud	0,63	Commerce de détail et grands magasins	1,76
Espagne	0,57	Pétrole	1,52
Italie	0,36	Sociétés immobilières	1,21
Jersey	0,17	Energie et service des eaux	1,13
Belgique	0,15	Articles de bureau et ordinateurs	1,06
Finlande	0,15	Supranational	0,96
Bermudes	0,13	Services divers	0,92
Liechtenstein	0,09	Santé, éducation et services sociaux	0,85
Portugal	0,07	Véhicules routiers	0,65
Curacao	0,02	Arts graphiques et maisons d'édition	0,60
	<b>92,24</b>	Biens de consommation divers	0,55
		Circulation et transport	0,52
		Obligations d'Etats et de villes étrangers	0,43
		Textile et habillement	0,33
		Industrie aéronautique et spatiale	0,29
		Métaux non ferreux	0,28
		Biotechnologie	0,25
		Papier et bois	0,21
		Industrie horlogère	0,19
		Caoutchouc et pneus	0,15
		Service d'environnement et de recyclage	0,12
		Photographie et optique	0,10
		Métaux et pierres précieuses	0,09
		Gastronomie	0,09
		Mines, aciéries	0,08
		Maisons de commerce diverses	0,07
		Divers	0,05
		Agriculture et pêche	0,05
			<b>92,24</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers

au 31 mars 2020

#### Note 1: Etats financiers

Les états financiers du Fonds sont établis conformément aux dispositions et règlements légaux en vigueur au Luxembourg concernant les organismes de placement collectif.

#### Note 2: Principales règles d'évaluation

L'actif net de chaque compartiment ou classe de parts correspond à la différence entre la somme des avoirs du compartiment ou d'une classe de parts et le total des obligations imputables au compartiment ou à la classe de parts.

Le total de l'actif net du Fonds est exprimé en CHF. Aux fins de ce calcul, l'actif net de chacun des compartiments, dans le cas où ceux-ci ne sont pas libellés en CHF, est converti au dernier cours moyen de change connu à la date de clôture. Cette conversion a été faite sur la base des cours de change ci-dessous:

1 CHF	=	1,688650 AUD
	=	37,997560 BEF
	=	5,360535 BRL
	=	1,471086 CAD
	=	7,330993 CNY
	=	7,028863 DKK
	=	0,941935 EUR
	=	0,833532 GBP
	=	8,010867 HKD
	=	339,760500 HUF
	=	16857,580000 IDR
	=	3,656083 ILS
	=	78,185790 INR
	=	111,575581 JPY
	=	1258,877000 KRW
	=	24,246090 MXN
	=	10,853190 NOK
	=	1,743338 NZD
	=	52,565250 PHP
	=	10,239944 SEK
	=	1,471603 SGD
	=	33,917630 THB
	=	31,255870 TWD
	=	1,033538 USD
	=	18,459000 ZAR

#### Principes de valorisation:

a) Les titres, instruments dérivés et autres placements cotés en bourse sont évalués à leur dernier prix de marché connu. Dans le cas où ces valeurs mobilières, produits dérivés et autres placements sont cotés sur plusieurs places boursières, l'évaluation est effectuée par rapport au dernier cours connu du marché sur lequel le titre est principalement négocié.

Pour les valeurs mobilières, instruments dérivés et autres placements dont les échanges en Bourse sont très limités et pour lesquels il existe un second marché entre des courtiers avec une formation des prix conforme au marché, la société de gestion peut procéder à l'évaluation de ces valeurs mobilières, dérivés et autres placements sur la base de ces prix. Les valeurs mobilières, instruments dérivés et autres placements qui ne sont pas cotés en Bourse, mais négociés sur un autre marché réglementé, reconnu, ouvert au public et en fonctionnement régulier sont évalués au dernier cours disponible sur ce marché.

b) Les titres et autres placements qui ne sont ni cotés en bourse ni négociés sur un marché réglementé sont évalués à leur dernier prix de marché disponible. Si un tel prix de marché n'était pas disponible, l'évaluation des valeurs mobilières serait effectuée par la société de gestion en fonction d'autres critères fixés par le Conseil d'administration et sur la base du prix probable de réalisation déterminé avec prudence et de bonne foi.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### **Note 2: Principales règles d'évaluation (suite)**

- c) Les instruments du marché monétaire non cotés en Bourse, mais négociés sur un autre marché réglementé reconnu, ouvert au public et en fonctionnement régulier, peuvent être évalués comme suit: L'évaluation de ces placements est régulièrement ajustée au prix de remboursement, en se fondant sur le prix net d'acquisition et en prenant en compte un rendement constant. En cas de modification importante des conditions du marché, la base d'évaluation des différents placements est adaptée en fonction des nouveaux rendements offerts sur le marché.
- d) Les liquidités, fonds confiés en fiducie et dépôts à terme fixe sont évalués sur la base de leur valeur nominale plus les intérêts courus.
- e) Les parts des OPCVM et autres OPC sont évaluées selon leur dernière valeur nette d'inventaire publiée. Si aucune valeur nette d'inventaire n'est disponible, mais uniquement des prix d'achat et de vente, les parts d'OPCVM et autres OPC peuvent être évaluées à la valeur moyenne entre les prix d'achat et de vente. Si aucun prix réel n'est disponible, l'évaluation est effectuée par la société de gestion selon d'autres critères établis par le Conseil d'administration et sur la base du prix probable de réalisation déterminé avec prudence et de bonne foi.
- f) Les instruments dérivés qui ne sont ni négociés en Bourse ni sur un autre marché réglementé sont à évaluer à la valeur normale de marché (Fair Value ou juste valeur de marché), déterminée avec prudence et en fonction des circonstances du moment.
- g) Pour chaque compartiment, les valeurs libellées dans une autre devise que celle du compartiment sont converties dans la devise du compartiment au cours de change moyen correspondant. Les contrats à terme conclus pour couvrir le risque de change sont pris en compte lors de la conversion.
- h) Les dividendes sont comptabilisés à la date « ex-dividende » et les taux sont régularisés quotidiennement.
- i) Calcul de la valeur nette d'inventaire

La valeur nette d'inventaire des parts est calculée par la société de gestion pour chaque compartiment et chaque classe de parts conformément aux conditions contractuelles et au paragraphe 3.1 du prospectus de vente chaque jour bancaire ouvré au Luxembourg.

- j) **Swinging Single Prices (SSP)**

La méthode SSP est appliquée à tous les compartiments. La méthode SSP permet de prendre en compte, lors du calcul de la valeur nette d'inventaire, les frais accessoires engendrés par les souscriptions et les rachats pour l'achat et la vente des placements (écarts entre le cours acheteur et le cours vendeur, courtages conformes au Marché, commissions, taxes, etc.) . Si, un jour bancaire ouvré, la somme des souscriptions et des rachats de toutes les classes de parts d'un compartiment entraîne des entrées ou des sorties nettes de capitaux, la valeur nette d'inventaire du compartiment concerné sera augmentée ou réduite en conséquence. Cette somme sera désignée comme la « valeur nette d'inventaire modifiée ». L'ajustement entraîne un relèvement de la valeur nette d'inventaire si les mouvements nets se traduisent par une augmentation du nombre de parts du compartiment concerné. Il entraîne une réduction de la valeur nette d'inventaire si les mouvements nets provoquent une diminution du nombre de parts.

Les coûts de transaction, engendrés par les souscriptions et rachats au jour de la négociation, seront supportés par les investisseurs qui ont donné mandat pour ces transactions.

Le supplément, voire la décote, qui seront appliqués aux coûts de transaction et qui sont liés aux souscriptions ou aux rachats, sont calculés respectivement de manière forfaitaire en fonction d'une valeur moyenne constatée sur une période précédente d'un an maximum.

L'adaptation maximale se monte à 2% de la valeur nette d'inventaire du compartiment considéré. Si le fonds évolue sur le marché depuis moins d'une année, ce facteur sera déterminé en fonction des particularités du fonds de manière à ce qu'il en résulte une valeur représentative.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite) au 31 mars 2020

#### Note 2: Principales règles d'évaluation (suite)

Au 31 mars 2020, des valeurs de Swinging Single Prices ont été enregistrées dans les compartiments ci-après:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	en autres actifs nets
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	en intérêts bancaires et frais à payer
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	en intérêts bancaires et frais à payer
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	en autres actifs nets
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)	en intérêts bancaires et frais à payer
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	en intérêts bancaires et frais à payer
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	en autres actifs nets
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	en intérêts bancaires et frais à payer
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	en intérêts bancaires et frais à payer
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	en intérêts bancaires et frais à payer

Ces sommes seront débitées le lendemain, au moment de la comptabilisation définitive des capitaux.

#### Note 3: Informations d'ordre fiscal à l'intention des investisseurs domiciliés en République fédérale d'Allemagne (conformément à l'art. 5 de la loi fiscale sur les investissements, alinéa 1, phrase 1, n° 1)

Les présentes informations ont été publiées dans le « Bundesanzeiger ». Elles sont également disponibles sur le site internet de Swisscanto ([www.swisscanto.com](http://www.swisscanto.com)).

Les investisseurs devraient consulter leur propre conseiller fiscal afin d'être conseillés sur les éventuelles conséquences fiscales qui pourraient résulter de l'acquisition, de la détention, du transfert ou de l'aliénation de parts conformément aux lois des pays dont ils possèdent la nationalité ou dans lesquels ils résident ou sont domiciliés.

#### Note 4: Explications sur les contrats de futures

Les contrats à terme suivants étaient ouverts à la date du rapport:

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en CHF)
Achat	15	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	1.915.875	(10.163)
Vente	(13)	EURO STOXX 50 PR	EUR	(357.110)	(56.034)
Achat	7	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	8.302.000	64.086
Achat	22	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	3.425.950	167.959
Vente	(26)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(3.340.675)	(218.028)
Achat	(47)	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	(1.980.815)	(43.132)
					<b>(95.312)</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite) au 31 mars 2020

#### Note 4: Explications sur contrats de futures (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en EUR)
Achat	3	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	383.175	(1.915)
Achat	2	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	182.300	29.361
Achat	11	EURO STOXX 50 PR	EUR	302.170	2.805
Achat	6	EURO STOXX 50 PR	EUR	164.820	3.720
Achat	6	HANG SENG I	HKD	1.423.200	11.093
Vente	(1)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(9.400.000)	3.602
Vente	(4)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(513.950)	(15.803)
Achat	5	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	778.625	35.957
Vente	(2)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(256.975)	(733)
Vente	(9)	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	(379.305)	(7.780)
Achat	3	10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	424.230	(17.610)
Achat	6	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	1.259.400	(12.720)
Achat	3	10Y TREASURY NOTES USA	USD	416.063	16.362
					<b>46.339</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en CHF)
Achat	109	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	13.922.025	(73.854)
Achat	59	EURO STOXX 50 PR	EUR	1.620.730	15.972
Vente	(27)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(1.521.585)	(180.101)
Achat	51	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	60.486.000	466.912
Vente	(45)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(423.000.000)	172.074
Achat	174	NASDAQ 100 INDEX 100-INDEX	USD	27.096.150	1.328.405
Vente	(45)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(5.781.938)	(377.357)
Achat	39	NASDAQ 100 INDEX 100-INDEX	USD	6.073.275	255.941
Vente	(102)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(13.105.725)	(39.670)
Achat	47	EURO BUND	EUR	8.107.970	(22.953)
Achat	72	10Y TREASURY NOTES USA	USD	9.985.500	416.893
					<b>1.962.262</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

Notes aux Etats Financiers (suite)  
au 31 mars 2020**Note 4: Explications sur les contrats de futures (suite)****Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)**

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en EUR)
Achat	27	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	3.448.575	(17.232)
Achat	27	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	2.461.050	396.374
Achat	57	EURO STOXX 50 PR	EUR	1.565.790	228.405
Achat	38	EURO STOXX 50 PR	EUR	1.043.860	23.560
Vente	(10)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(563.550)	(62.831)
Vente	(11)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(619.905)	(17.834)
Achat	12	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	14.232.000	103.483
Vente	(23)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(216.200.000)	82.842
Vente	(15)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(141.000.000)	(950)
Achat	49	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	7.630.525	352.369
Vente	(40)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(5.139.500)	(315.952)
Vente	(15)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(1.927.313)	(5.495)
Achat	54	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	11.334.600	(114.480)
Achat	53	10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	7.494.730	(311.110)
Achat	25	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	3.900.781	71.913
					<b>413.062</b>

**Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)**

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en USD)
Achat	2	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	255.450	(1.401)
Achat	3	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	273.450	48.325
Vente	(2)	EURO STOXX 50 PR	EUR	(54.940)	(8.910)
Achat	5	HANG SENG I	HKD	1.186.000	10.143
Vente	(2)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(18.800.000)	7.904
Vente	(3)	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	(126.435)	(9.045)
Vente	(1)	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	(42.145)	(2.990)
Achat	3	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	467.175	23.672
Achat	1	S&P 500 EMINI INDEX	USD	128.488	5.172
Achat	1	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	155.725	6.783
Achat	1	EURO BUND	EUR	172.510	(505)
Achat	1	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	209.900	(2.326)
Achat	2	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	312.063	17.344
					<b>94.166</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 4: Explications sur les contrats de futures (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en CHF)
Achat	103	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	13.155.675	(69.788)
Vente	(85)	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	(7.747.750)	(832.691)
Achat	193	EURO STOXX 50 PR	EUR	5.301.710	52.248
Vente	(56)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(3.155.880)	(373.543)
Achat	51	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	60.486.000	466.912
Achat	195	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	30.366.375	1.488.729
Achat	115	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	4.846.675	336.996
Vente	(45)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(5.781.938)	(377.357)
Achat	44	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	6.851.900	288.754
Vente	(100)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(12.848.750)	(38.892)
Achat	38	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	7.976.200	(85.526)
Achat	15	10Y TREASURY NOTES USA	USD	2.080.313	86.853
Achat	47	TREASURY BONDS USA	USD	8.415.938	596.147
					<b>1.538.842</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en EUR)
Achat	22	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	2.809.950	(14.041)
Achat	19	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	1.731.850	278.930
Achat	72	EURO STOXX 50 PR	EUR	1.977.840	288.511
Achat	40	EURO STOXX 50 PR	EUR	1.098.800	24.800
Vente	(10)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(563.550)	(62.831)
Vente	(7)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(394.485)	(11.349)
Vente	10	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	11.860.000	86.235
Vente	(15)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(141.000.000)	54.027
Vente	(18)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(2.312.775)	(71.114)
Achat	42	NASDAQ 100 INDEX 100-INDEX	USD	6.540.450	302.032
Vente	(24)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(3.083.700)	(8.792)
Achat	16	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	3.358.400	(33.920)
Achat	45	10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	6.363.450	(264.150)
Achat	20	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	3.120.625	(47.790)
					<b>520.548</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 4: Explications sur les contrats de futures (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en USD)
Achat	2	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	255.450	(1.401)
Achat	2	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	182.300	32.216
Vente	(3)	EURO STOXX 50 PR	EUR	(82.410)	(2.074)
Vente	(1)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(56.355)	(6.894)
Achat	4	HANG SENG I	HKD	948.800	8.115
Vente	(1)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(9.400.000)	3.952
Achat	4	NASDAQ 100 INDEX 100-INDE	USD	622.900	31.562
Achat	6	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	252.870	18.172
Achat	1	NASDAQ 100 INDEX 100-INDE	USD	155.725	6.783
Vente	(1)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(128.488)	(402)
Achat	1	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	209.900	(2.326)
Vente	3	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	468.094	26.016
					<b>113.719</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en CHF)
Achat	26	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	3.320.850	(17.616)
Vente	(56)	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	(5.104.400)	(548.597)
Vente	(14)	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	(1.276.100)	(29.820)
Vente	(26)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(1.465.230)	(173.431)
Achat	14	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	16.604.000	128.172
Achat	51	NASDAQ 100 INDEX 100-INDE	USD	7.941.975	389.359
Achat	110	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	4.635.950	322.344
Vente	(24)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(3.083.700)	(201.257)
Achat	9	NASDAQ 100 INDEX 100-INDE	USD	1.401.525	59.063
Vente	(21)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(2.698.238)	(8.167)
Achat	5	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	1.049.500	(55.099)
Achat	3	10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	424.230	(5.669)
Achat	4	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	839.600	(81.619)
Achat	1	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	209.900	(20.426)
Achat	14	EURO BUND	EUR	2.415.140	(6.837)
Achat	10	10Y TREASURY NOTES USA	USD	1.386.875	57.902
Achat	22	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	3.432.688	103.105
					<b>(88.593)</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

## Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

**Note 4: Explications sur les contrats de futures (suite)****Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)**

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en EUR)
Achat	6	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	766.350	(3.829)
Achat	3	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	273.450	44.042
Achat	16	EURO STOXX 50 PR	EUR	439.520	64.114
Achat	43	EURO STOXX 50 PR	EUR	1.181.210	10.965
Vente	(4)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(225.420)	(25.132)
Achat	3	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	3.558.000	25.871
Vente	(6)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(56.400.000)	21.611
Vente	(9)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(1.156.388)	(35.557)
Achat	13	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	2.024.425	93.484
Achat	2	NASDAQ 100 E-MINI INDEX	USD	311.450	12.363
Vente	(5)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(642.438)	(1.832)
Achat	2	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	419.800	(4.240)
Achat	2	10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	282.820	(11.740)
Achat	2	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	419.800	(20.440)
Achat	5	10Y TREASURY NOTES USA	USD	693.438	27.270
Achat	5	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	780.156	22.642
					<b>219.592</b>

**Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)**

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en USD)
Achat	2	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	255.450	(1.401)
Vente	(2)	EURO STOXX 50 PR	EUR	(54.940)	(8.910)
Achat	(1)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(56.355)	(6.894)
Achat	4	HANG SENG I	HKD	948.800	8.115
Vente	(1)	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	(9.400.000)	3.952
Achat	4	NASDAQ 100 INDEX 100-INDEX	USD	622.900	31.563
Vente	(1)	S&P 500 EMINI INDEX	USD	(128.488)	(402)
Achat	1	EURO BUND	EUR	172.510	(505)
Achat	3	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	468.094	26.016
					<b>51.534</b>



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 4: Explications sur les contrats de futures (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

	Nombre de contrats	Nom	Devise	Valeur	Résultat non réalisé (en CHF)
Achat	21	S&P / ASX 200 INDEX	AUD	2.682.225	(14.229)
Vente	(35)	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	(3.190.250)	(342.873)
Vente	(29)	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	CHF	(2.643.350)	(61.770)
Achat	17	EURO STOXX 50 PR	EUR	466.990	4.602
Vente	(9)	UKX FTSE 100 INDEX	GBP	(507.195)	(60.034)
Achat	12	HONG KONG HANG SENG INDICES	HKD	14.232.000	109.862
Achat	6	NIKKEI 225 INDICES D	JPY	56.400.000	(15.099)
Achat	43	NASDAQ 100 INDEX 100-INDEX	USD	6.696.175	328.284
Achat	68	MSEMI - MSCI EMER MKTS INDEX	USD	2.865.860	199.267
Achat	8	NASDAQ 100 INDEX 100-INDEX	USD	1.245.800	52.501
Achat	3	EURO BUND	EUR	517.530	(1.465)
Achat	4	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	839.600	(9.003)
Achat	2	EURO-BUXL-FUTURES	EUR	419.800	(43.060)
Achat	20	USA 6% 96-15.02.26 TBO	USD	3.120.625	(13.470)
					<b>133.513</b>

Les futures ont été conclus avec la contrepartie suivante : J.P. Morgan Securities PLC.

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme

Les contrats de change à terme suivants étaient ouverts à la date du rapport:

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CHF	418.805	GBP	350.000	01.04.2020	(1.084)
CAD	6.000.000	CHF	4.310.232	02.04.2020	(231.873)
CHF	15.419.571	EUR	14.536.000	02.04.2020	(12.196)
CHF	25.694.310	USD	26.600.000	02.04.2020	(40.937)
CHF	3.561.369	JPY	400.000.000	02.04.2020	(23.537)
CHF	3.819.132	GBP	3.080.000	02.04.2020	124.217
CHF	3.681.740	GBP	3.080.000	07.05.2020	(10.133)
CAD	6.000.000	CHF	4.059.480	07.05.2020	14.288
CHF	17.946.900	EUR	17.000.000	07.05.2020	(100.135)
CHF	25.621.519	USD	26.600.000	07.05.2020	(76.498)
CHF	3.561.682	JPY	400.000.000	07.05.2020	(23.894)
					<b>(381.782)</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CAD	6.600.000	EUR	4.467.970	02.04.2020	(242.185)
EUR	12.399.207	CHF	13.152.000	02.04.2020	10.640
EUR	5.415.981	JPY	645.000.000	02.04.2020	(29.132)
EUR	5.934.486	GBP	5.075.000	02.04.2020	199.672
EUR	64.662.317	USD	71.000.000	02.04.2020	(42.136)
CAD	6.600.000	EUR	4.227.623	07.05.2020	(6.460)
EUR	5.441.270	JPY	645.000.000	07.05.2020	(5.037)
EUR	5.750.220	GBP	5.075.000	07.05.2020	19.977
EUR	5.872.269	CHF	6.200.000	07.05.2020	31.971
EUR	64.743.688	USD	71.000.000	07.05.2020	131.228
					<b>68.538</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CHF	13.523.321	USD	14.000.000	02.04.2020	(21.546)
CHF	2.025.616	AUD	3.222.000	02.04.2020	117.710
CHF	2.897.829	GBP	2.337.000	02.04.2020	94.252
CHF	3.232.674	CAD	4.500.000	02.04.2020	173.915
CHF	3.444.132	EUR	3.256.000	02.04.2020	(12.516)
CHF	7.143.074	JPY	802.284.000	02.04.2020	(47.208)
CHF	9.571.463	EUR	9.023.000	02.04.2020	(7.570)
USD	1.511.000	CHF	1.403.885	02.04.2020	57.993
CHF	12.911.211	EUR	12.230.000	07.05.2020	(72.038)
CHF	14.148.665	USD	14.689.000	07.05.2020	(42.243)
CHF	2.248.491	GBP	1.881.000	07.05.2020	(6.188)
CHF	4.107.517	CAD	6.071.000	07.05.2020	(14.474)
CHF	6.660.443	JPY	748.011.000	07.05.2020	(44.682)
					<b>175.405</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CAD	306.000	USD	227.488	02.04.2020	(11.394)
EUR	660.876	CHF	701.000	02.04.2020	567
EUR	212.357	JPY	25.290.000	02.04.2020	(1.142)
CHF	269.000	EUR	254.306	02.04.2020	(921)
EUR	356.832	GBP	315.000	07.05.2020	1.162
CHF	124.000	EUR	117.439	07.05.2020	(634)
AUD	331.000	EUR	184.506	07.05.2020	(100)
EUR	654.732	USD	718.000	07.05.2020	1.327
					<b>(11.135)</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CAD	13.500.000	CHF	9.698.022	02.04.2020	(521.715)
CHF	128.943.900	USD	133.489.000	02.04.2020	(205.437)
CHF	16.405.110	EUR	15.509.000	02.04.2020	(59.618)
CHF	20.878.370	EUR	19.682.000	02.04.2020	(16.514)
CHF	28.087.982	GBP	22.652.000	02.04.2020	913.559
CHF	31.430.731	JPY	3.530.185.000	02.04.2020	(207.722)
USD	22.783.000	CHF	21.167.913	02.04.2020	874.420
AUD	12.919.000	CHF	7.609.808	07.05.2020	30.895
CHF	26.975.571	JPY	3.029.532.000	07.05.2020	(180.967)
CHF	28.593.250	GBP	23.920.000	07.05.2020	(78.694)
CHF	33.990.373	EUR	32.197.000	07.05.2020	(189.650)
CHF	99.740.913	USD	103.550.000	07.05.2020	(297.794)
					<b>60.763</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite) au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CAD	1.428.000	EUR	966.706	02.04.2020	(52.400)
CHF	2.140.000	EUR	2.023.105	02.04.2020	(7.325)
EUR	10.524.211	GBP	9.000.000	02.04.2020	354.096
EUR	24.288.441	USD	26.669.000	02.04.2020	(15.827)
EUR	3.904.460	JPY	464.990.000	02.04.2020	(21.001)
EUR	5.359.602	CHF	5.685.000	02.04.2020	4.599
USD	2.212.000	EUR	1.942.148	02.04.2020	73.714
AUD	3.209.000	EUR	1.788.760	07.05.2020	(967)
CHF	2.517.000	EUR	2.383.832	07.05.2020	(12.860)
EUR	1.438.032	CAD	2.245.000	07.05.2020	2.201
EUR	18.397.238	USD	20.175.000	07.05.2020	37.289
EUR	4.599.940	JPY	545.270.000	07.05.2020	(4.258)
EUR	6.645.328	GBP	5.865.000	07.05.2020	23.087
					<b>380.348</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en USD)
USD	914.756	EUR	833.000	02.04.2020	708
USD	418.548	CAD	563.000	02.04.2020	23.005
EUR	565.657	CHF	600.000	02.04.2020	532
CHF	759.000	USD	785.827	02.04.2020	(1.323)
CHF	168.000	USD	177.247	02.04.2020	(3.602)
CAD	229.000	USD	163.422	02.04.2020	(2.534)
CAD	280.000	USD	195.497	02.04.2020	1.221
USD	232.443	EUR	212.000	07.05.2020	(514)
AUD	269.000	USD	164.534	07.05.2020	146
CHF	612.000	USD	635.304	07.05.2020	(1.821)
					<b>15.818</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CAD	27.000.000	CHF	19.396.044	02.04.2020	(1.043.429)
CHF	13.251.868	EUR	12.528.000	02.04.2020	(48.159)
CHF	12.936.710	JPY	1.453.004.000	02.04.2020	(85.497)
CHF	36.706.157	USD	38.000.000	02.04.2020	(58.481)
CHF	14.850.990	EUR	14.000.000	02.04.2020	(11.746)
USD	12.445.000	CHF	11.562.774	02.04.2020	477.644
AUD	10.016.000	CHF	5.899.825	07.05.2020	23.953
CAD	18.627.000	CHF	12.602.655	07.05.2020	44.356
CHF	19.282.361	EUR	18.265.000	07.05.2020	(107.586)
CHF	19.091.682	JPY	2.144.120.000	07.05.2020	(128.078)
CHF	19.283.564	USD	20.020.000	07.05.2020	(57.575)
					<b>(994.598)</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CAD	1.246.000	EUR	843.499	02.04.2020	(45.722)
CHF	2.062.000	EUR	1.949.366	02.04.2020	(7.058)
EUR	2.795.932	GBP	2.391.000	02.04.2020	94.071
EUR	3.313.809	CHF	3.515.000	02.04.2020	2.844
EUR	1.931.280	JPY	230.000.000	02.04.2020	(10.388)
EUR	7.098.283	USD	7.794.000	02.04.2020	(4.625)
AUD	2.636.000	EUR	1.469.359	07.05.2020	(794)
CHF	2.183.000	EUR	2.067.503	07.05.2020	(11.154)
EUR	3.357.222	GBP	2.963.000	07.05.2020	11.664
EUR	3.295.959	JPY	390.698.000	07.05.2020	(3.051)
EUR	1.904.012	USD	2.088.000	07.05.2020	3.859
USD	1.450.000	EUR	1.273.108	07.05.2020	48.321
					<b>77.967</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en USD)
CHF	420.000	USD	434.845	02.04.2020	(732)
USD	239.396	EUR	218.000	02.04.2020	185
USD	187.116	JPY	20.291.000	02.04.2020	(846)
USD	365.108	AUD	561.000	02.04.2020	21.744
EUR	313.940	CHF	333.000	02.04.2020	296
USD	304.098	EUR	267.000	02.04.2020	11.120
CHF	435.000	USD	451.564	07.05.2020	(1.294)
USD	146.888	EUR	134.000	07.05.2020	(358)
USD	197.535	AUD	323.000	07.05.2020	(203)
					<b>29.912</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CAD	6.000.000	CHF	4.310.232	02.04.2020	(231.873)
CHF	4.896.883	JPY	550.000.000	02.04.2020	(32.363)
CHF	4.940.890	EUR	4.671.000	02.04.2020	(17.956)
EUR	3.330.000	CHF	3.532.414	02.04.2020	2.794
USD	2.839.000	CHF	2.637.743	02.04.2020	108.962
USD	4.844.000	CHF	4.679.069	02.04.2020	7.454
AUD	2.993.000	CHF	1.762.997	07.05.2020	7.158
CAD	4.432.000	CHF	2.998.603	07.05.2020	10.554
CHF	3.980.847	JPY	447.075.000	07.05.2020	(26.706)
USD	7.890.000	CHF	7.599.766	07.05.2020	22.656
					<b>(149.320)</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en EUR)
CAD	989.000	EUR	669.519	02.04.2020	(36.289)
CHF	548.000	EUR	518.066	02.04.2020	(1.876)
EUR	1.261.416	CHF	1.338.000	02.04.2020	1.082
EUR	317.838	JPY	37.852.000	02.04.2020	(1.710)
EUR	450.202	GBP	385.000	02.04.2020	15.147
USD	374.000	EUR	328.374	02.04.2020	12.463
USD	725.000	EUR	660.284	02.04.2020	430
AUD	762.000	EUR	424.754	07.05.2020	(230)
CAD	876.000	EUR	561.121	07.05.2020	(857)
CHF	712.000	EUR	674.330	07.05.2020	(3.638)
EUR	532.674	JPY	63.148.000	07.05.2020	(541)
USD	956.000	EUR	871.760	07.05.2020	(1.764)
					<b>(17.783)</b>

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en USD)
AUD	195.000	USD	119.272	07.05.2020	106
CAD	50.000	USD	34.910	02.04.2020	218
CHF	231.000	USD	239.796	07.05.2020	(687)
CHF	400.000	USD	414.138	02.04.2020	(697)
CHF	179.000	USD	188.853	02.04.2020	(3.838)
EUR	378.990	CHF	402.000	02.04.2020	357
USD	238.425	EUR	214.000	02.04.2020	3.603
USD	289.292	EUR	254.000	02.04.2020	10.577
USD	64.215	GBP	50.000	02.04.2020	2.217
USD	31.394	JPY	3.404.000	02.04.2020	(138)
USD	37.171	CAD	50.000	02.04.2020	2.043
USD	37.337	EUR	34.000	02.04.2020	29
					<b>13.790</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite) au 31 mars 2020

#### Note 5: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

##### Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CHF	3.266.425	EUR	3.088.000	02.04.2020	(11.871)
EUR	7.612.000	CHF	8.074.695	02.04.2020	6.386
USD	11.000.000	CHF	10.625.467	02.04.2020	16.928
AUD	2.542.000	CHF	1.497.340	07.05.2020	6.079
EUR	3.000.000	CHF	3.167.100	07.05.2020	17.670
GBP	1.024.000	CHF	1.224.798	07.05.2020	2.627
JPY	117.424.000	CHF	1.045.567	07.05.2020	7.015
USD	9.464.000	CHF	9.115.867	07.05.2020	27.177
					<b>72.011</b>

Les opérations de change à terme ont été conclues avec les contreparties suivantes: RBC Investor Services Bank S.A. et Zürcher Kantonalbank.

#### Note 6: Taxe d'abonnement

En conformité avec la législation en vigueur au Luxembourg, le Fonds est soumis à une taxe d'abonnement au taux annuel de 0,05% pour les parts de classe A et B et de 0,01% pour les parts de classe D, payable trimestriellement et calculée sur la base du total des avoirs nets de tous les compartiments à la fin de chaque trimestre.

Selon l'article 175a de la loi modifiée du 17 décembre 2010, les actifs nets investis en OPCVM déjà soumis à la taxe d'abonnement sont exonérés de cette taxe.



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 7: Commission de gestion

Une commission de gestion forfaitaire, à verser à la société de gestion, est facturée au Fonds pour la direction, la gestion et la distribution des parts du Fonds. Ces frais sont payables mensuellement sur la base du volume net moyen de chaque compartiment.

La commission de gestion forfaitaire se compose de deux éléments: les frais forfaitaires de gestion (coûts de la gestion des actifs et de la distribution) et les frais forfaitaires d'administration (coûts de direction et d'administration).

Au 31 mars 2020, la commission de gestion forfaitaire effective était de:

Compartiment	Classe	FCG (p.a.)	FFG (p.a.)	FFA (p.a.)
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	AA, AT	1,45%	1,20%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced	BT	0,85%	0,60%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	AA, AT	1,45%	1,20%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)	DA	0,73%	0,61%	0,12%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	AA, AT	0,90%	0,70%	0,20%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	BT	0,55%	0,35%	0,20%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	AA, AT	0,90%	0,70%	0,20%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	AA, AT	1,20%	0,95%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	BA, BT	0,73%	0,48%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	AA, AT	1,20%	0,95%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	BT	0,73%	0,48%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)	AA, AT	1,20%	0,95%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	AA, AT	1,35%	1,10%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	BA, BT	0,80%	0,55%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	AA, AT	1,35%	1,10%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	BT	0,80%	0,55%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)	AA, AT	1,35%	1,10%	0,25%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)	AA, AT	1,50%	1,20%	0,30%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)	BT	0,90%	0,60%	0,30%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	AA, AT	1,50%	1,20%	0,30%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	DT	0,75%	0,60%	0,15%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)	AA, AT	1,50%	1,20%	0,30%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	AA, AT	1,65%	1,30%	0,35%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	BT	1,00%	0,65%	0,35%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	DT	0,83%	0,63%	0,20%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	NT	0,00%	0,00%	0,00%

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### **Note 7: Commission de gestion (suite)**

FCG = Commission forfaitaire de gestion. FFG = Commission forfaitaire de management. FFA = Commission forfaitaire d'administration

Outre les commissions de gestion forfaitaires, le Fonds supporte les frais suivants:

- la taxe d'abonnement;
- les coûts de transaction usuels lors des opérations d'achat et de vente;
- les coûts des mesures extraordinaires prises dans l'intérêt des détenteurs de parts.

Si le Fonds investit dans des parts d'autres OPCVM et/ou OPC gérés directement ou par délégation par la même société de gestion ou par une autre société de gestion avec laquelle la société de gestion est liée dans le cadre d'une communauté de gestion ou de contrôle ou d'une participation directe ou indirecte significative (plus de 10% du capital ou des voix), la société de gestion concernée peut ne pas facturer de commissions de souscription, de rachat ou de gestion au titre des placements du Fonds en parts de ces autres OPCVM et/ou OPC. Il n'existe ainsi pas de double facturation des commissions de souscription, de rachat et de gestion au sein du Fonds.

#### **Note 8: Total Expense Ratio (« TER »)**

Le TER mentionné à la rubrique « Statistiques » du présent rapport a été calculé en vertu des « Directives sur le calcul et la publication du TER » promulguées par l'association suisse des fonds de placement (Swiss Funds and Asset Management Association, SFAMA) le 16 mai 2008. Ces mêmes directives de la SFAMA régissent également le calcul du TER synthétique. Cette directive a été adaptée au règlement modifié de la FINMA sur les placements collectifs. Les directives TER modifiées sont entrées en vigueur le 1er juin 2015. L'indication du PTR dans le rapport annuel n'est plus obligatoire.

Le TER a été calculé pour les douze derniers mois précédant la date du présent rapport.

**Total Expense Ratio (TER)** = (Charges d'exploitation/actif net moyen) x 100

Les charges d'exploitation comprennent l'ensemble des commissions et frais imputés sur le fonds. Les frais accessoires générés dans le cadre de l'achat et de la vente des titres de placement ne font pas partie des charges d'exploitation.

Si un fonds investit au moins 10% de ses actifs nets dans d'autres fonds qui publient un TER au sens de la directive du 16 mai 2008 de la Swiss Funds and Asset Management Association (SFAMA), un TER consolidé (synthétique) devra être calculé à la date des états financiers annuels ou semestriels pour le fonds de fonds. Celui-ci correspond à la somme du TER proportionnel de chaque fonds cible, pondéré en fonction de sa part dans l'actif net du fonds à la date de référence, des frais d'entrée et de sortie des fonds cibles effectivement facturés et du TER du fonds de fonds minoré des rétrocessions des fonds cibles perçues au cours de la période sous revue. Le TER synthétique sera calculé sur la base des informations disponibles au moment de la préparation du présent document.

Les compartiments concernés sont les suivants:

- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balanced (EUR)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balanced (USD)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)
- Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 9: Mouvements dans le portefeuille des titres

Les informations relatives aux mouvements dans le portefeuille des titres pendant la période sous revue sont disponibles pour tous les détenteurs de parts sur le site internet de Swisscanto ([www.swisscanto.com](http://www.swisscanto.com)) ou peuvent être obtenues gratuitement directement auprès de Swisscanto Fondsleitung AG, au siège de la société de gestion, de la banque dépositaire et du représentant en Suisse, de l'Agent payeur et d'information en Allemagne ainsi qu'auprès de toutes les agences des Banques Cantonales et de tous les agents payeurs et distributeurs.

#### Note 10: Frais de transaction

Au cours de l'exercice sous revue, le fonds s'est acquitté des frais de transaction suivants au titre de l'achat ou de la vente de valeurs mobilières ou d'instruments du marché monétaire:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced*	CHF	216.688
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Balanced (EUR)*	EUR	569.202
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)*	CHF	73.747
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)*	EUR	30.802
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)*	USD	1.496
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)*	CHF	878.223
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)*	EUR	358.332
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)*	USD	4.252
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)*	CHF	2.182.568
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)*	EUR	593.164
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)*	USD	5.435
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)*	CHF	994.598
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)*	EUR	317.832
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)*	USD	7.409
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)*	CHF	1.025.157
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)*	EUR	41.215
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD)*	USD	5.435

Les frais de transaction, indiqués dans l'Etat « Compte de résultat » et qui sont avant tout liés aux droits de garde délégués et autres commissions similaires, ne sont, de ce fait, pas inclus dans les valeurs susmentionnées mais sont néanmoins en relation directe avec les achats et ventes de titres. En raison de restrictions techniques de saisie comptable, ces frais de transaction ne peuvent être imputés aux coûts d'acquisition des divers titres.

\* Les obligations sont traitées ordinairement en « net ».

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite)

au 31 mars 2020

#### Note 11: Prêt de titres (Securities Lending)

Dans le but d'assurer une gestion efficace des actifs, un compartiment peut, afin de générer un revenu supplémentaire et conformément aux exigences légales en vigueur, recourir à des techniques et instruments de prêts de titres (Securities Lending), conformément à l'article 51 paragraphe 2 de la directive sur les OPCVM et à l'article 11 de la directive 2007/16/CE du 19 mars 2007 (Directive sur les actifs éligibles). Dans le cadre d'un prêt de titres, le compartiment agit en qualité d'emprunteur ou de prêteur, ce dernier remettant un titre pour une durée déterminée à un emprunteur en contrepartie d'une commission. La Banque cantonale de Zurich est le seul emprunteur (Principal) direct et la seule contrepartie directe du prêt de titres. En tant que fondation indépendante de droit public du canton de Zurich, elle dispose d'une garantie illimitée de l'Etat. Elle est dès lors soumise à la supervision de l'autorité fédérale suisse de surveillance des marchés financiers (Eidgenössische Finanzmarktaufsicht, FINMA), une supervision considérée par la CSSF comme équivalente à celle prévue par le droit de l'Union européenne.

Nous avons retiré les compartiments suivants du programme de prêts de titres avec effet au 01/03/2020:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (USD)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (USD)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (USD)  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)

Au 31 mars 2020, des transactions de prêt de titres étaient en cours pour les montants suivants:

<b>Compartiment</b>	<b>Devise</b>	<b>Valeur d'évaluation</b>	<b>Valeur de la garantie</b>
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	CHF	30.456.535	34.432.716
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	EUR	5.501.861	6.220.491
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	CHF	21.397.860	24.191.457
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	EUR	4.186.826	4.733.925

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite) au 31 mars 2020

#### Note 11: Prêt de titres (Securities Lending) (suite)

Compartiment	Devise	Revenus bruts	Coûts et frais directs et indirects déduits des revenus bruts des opérations de prêt de titres	Revenu après déduction des charges
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	CHF	7.870	708	7.162
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	EUR	806	73	733
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)	USD	641	58	583
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	CHF	58.395	5.256	53.139
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	EUR	12.205	1.098	11.107
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	CHF	48.735	4.386	44.349
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	EUR	8.812	793	8.019
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)	CHF	4.811	433	4.378
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	EUR	477	43	434
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	CHF	2.917	263	2.654
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)	EUR	195	18	177

#### Note 12: Informations complémentaires

Lancement de nouvelles classes de parts

Les classes de parts suivantes ont été créées au cours de l'exercice sous revue:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR) DT: 15 mai 2019

Les compartiments suivants ont été liquidés le 24 septembre 2019:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR). Les derniers cours calculés s'élevaient à 102,34 pour la classe AA EUR et 103,04 pour la classe AT EUR.

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD). Les derniers cours calculés s'élevaient à 98,11 pour la classe AA USD et 98,11 pour la classe AT USD.

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD). Les derniers cours calculés s'élevaient à 104,87 pour la classe AA USD et 105,83 pour la classe AT USD.

Les classes de parts suivantes ont été fermées au cours de la période sous revue:

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR) AA: 24 septembre 2019

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR) AT: 24 septembre 2019

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD) AA: 24 septembre 2019

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (USD) AT: 24 septembre 2019

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD) AA: 24 septembre 2019

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD) AT: 24 septembre 2019

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Notes aux Etats Financiers (suite) au 31 mars 2020

#### **Note 13: parties liées**

La Zürcher Kantonalbank est liée en tant que Gestionnaire du fonds. Swisscanto Asset Management International S.A., Société de gestion du fonds, fait partie du groupe Zürcher Kantonalbank.

#### **Note 14: événements postérieurs à la clôture de l'exercice**

L'épidémie de coronavirus bouleverse les perspectives de Swisscanto Asset Management International S.A. pour l'exercice 2020 en cours et, par conséquent, celles du Swisscanto (LU) Portfolio Fund placé sous sa gestion. L'organisation d'urgence s'avère très efficace. L'ensemble des fonctions clés et essentielles est assuré. Le personnel de la Société de gestion essentiel à la conduite des activités du Swisscanto (LU) Portfolio Fund est en mesure de poursuivre ses activités normalement. Les perturbations enregistrées sur les marchés financiers devraient perdurer pendant un moment encore et auront probablement un impact négatif sur le résultat, qu'il est toutefois impossible de quantifier à l'heure actuelle.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations non révisées complémentaires

#### Informations concernant la politique de rémunération

Le 18 mars 2016, la directive européenne 2014/91/UE modifiant la directive 2009/65/CE concernant les organismes de placement collectif en valeurs mobilières, applicable au Fonds, est entrée en vigueur. Elle a été transposée en droit national par la loi luxembourgeoise du 10 mai 2016 portant transposition de la directive 2014/91/UE. Compte tenu de ces nouvelles dispositions législatives, le Fonds est tenu de publier des informations relatives à la rémunération de collaborateurs identifiés au sens de la Loi dans le rapport annuel. Ces données correspondent aux Informations concernant la rémunération que la Société de gestion a publiées dans son dernier rapport annuel de 2017 et incluent le nombre total d'employés:

	<b>Nombre d'employés</b>	<b>CHF</b>
Rémunération globable Swisscanto Asset Management International S.A. (01/01/2019 – 31/12/2019):	10	2.030.326,96
dont la composante fixe:		1.409.669,89
dont la composante variable*:		620.657,07

Compte tenu du faible nombre d'employés et en application du principe de proportionnalité, il n'a pas été procédé à une nouvelle répartition des rémunérations pour les employés identifiés. Le calcul de la rémunération et des autres gratifications est basé sur la norme du marché en vigueur ainsi que sur la performance individuelle de l'employé. La partie fixe de la rémunération prend en compte des facteurs d'une portée à long terme, tels que la rentabilité durable, une saine gestion des risques et du capital, un service à la clientèle de premier ordre et un travail d'équipe. La même procédure s'applique à la partie variable de la rémunération, mais au sein de laquelle sont compris des facteurs tels que notamment la récompense du succès et de la performance ainsi que le respect constant des directives de gouvernance d'entreprise. Par ailleurs, la rémunération variable dépend dans une large mesure du résultat du groupe et de la Société de gestion ainsi que des fonds gérés par cette dernière.

De plus amples informations concernant la politique de rémunération sont disponibles sur le site internet [www.swisscanto.com/lu/de/gs/rechtliche-hinweise/verguetungspolitik.html](http://www.swisscanto.com/lu/de/gs/rechtliche-hinweise/verguetungspolitik.html).

La société de gestion:  
SWISSCANTO ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL S.A., Luxembourg

\* La base des rémunérations variables qui sont versées au mois de mars de chaque exercice se rapporte à l'exercice précédent.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations non révisées complémentaires (suite)

#### Règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) no 648/2012

#### Prêt de titres (voir Note 11 pour de plus amples informations)

#### Données générales (en CHF)

Nom du compartiment	Valorisation globale	Garantie	Total de l'actif net	(en %) des actifs
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	30.456.535	34.432.716	782.620.467	3,91%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	5.841.019	6.603.949	193.014.146	3,04%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	21.397.860	24.191.457	744.578.993	2,88%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	4.444.921	5.025.745	159.522.362	2,80%
<b>Total</b>	<b>62.140.335</b>	<b>70.253.867</b>		

#### Données générales (en CHF)

Nom du compartiment	Valorisation globale	Portefeuille d'investissement à la valeur d'évaluation	(%) des actifs mobilisables
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	30.456.535	731.128.043	4,18%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	5.841.019	162.687.495	3,60%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	21.397.860	694.807.972	3,09%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	4.444.921	140.922.757	3,17%
<b>Total</b>	<b>62.140.335</b>	<b>1.729.546.267</b>	



## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations non révisées complémentaires (suite)

#### Règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) no 648/2012 (suite)

##### Données en matière de concentration (en CHF)

<b>10 émetteurs principaux de garanties</b>	<b>Montant des garanties</b>
AMGEN INC	12.720.612
AMERICAN HONDA FINANCE	10.653.508
ALPHABET INC	7.228.412
GENWORTH FINANCIAL INC	3.381.927
ADVANCED DISPOSAL SERVICES INC	3.173.170
PBF ENERGY INC	3.017.506
TEXAS CAPITAL BANCSHARES INC,D	2.864.344
SUNRUN INC	2.279.650
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2.223.910
ISRA VISION AG	1.956.914

<b>10 contreparties principales</b>	<b>Pays</b>	<b>Valorisation globale</b>
ZÜRCHER KANTONALBANK	SCHWEIZ	62.140.335
	<b>Total</b>	<b>62.140.335</b>

<b>Type de garantie</b>	<b>Montant des garanties</b>
Obligations	21.854.230
Actions	48.399.637
<b>Total</b>	<b>70.253.867</b>

<b>Qualité des garanties</b>	<b>Montant des garanties</b>
INVESTMENT GRADE	21.854.230
NON APPLICABLE	48.399.637
<b>Total</b>	<b>70.253.867</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations non révisées complémentaires (suite)

#### Règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) no 648/2012 (suite)

#### Données de transactions consolidées pour chaque type d'opération de financement sur titres (SFT), divisées selon les catégories suivantes (en CHF):

Échéance de la garantie	Montant des garanties
moins d'un jour	-
un jour à une semaine	-
une semaine à un mois	-
un mois à trois mois	536.409
trois mois à un an	1.367.434
plus d'un an	19.950.387
Transactions ouvertes	48.399.637
<b>Total</b>	<b>70.253.867</b>

Devises des garanties en espèces	Montant des garanties
S.o.	-

Devises des garanties sous forme de titres	Montant des garanties
CHF	523.840
EUR	11.675.916
GBP	328.893
HKD	978.212
USD	56.747.006
<b>Total</b>	<b>70.253.867</b>

Echéances des opérations de financement sur titres (SFT)	Valorisation globale
moins d'un jour	-
un jour à une semaine	-
une semaine à un mois	-
un mois à trois mois	-
trois mois à un an	-
plus d'un an	60.799.689
Transactions ouvertes	1.340.646
<b>Total</b>	<b>62.140.335</b>

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations non révisées complémentaires (suite)

#### **Règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) no 648/2012 (suite)**

<b>Pays dans lequel les contreparties sont établies</b>	<b>Valorisation globale</b>
Suisse	62.140.335
<b>Total</b>	<b>62.140.335</b>

<b>Règlement et compensation</b>	<b>Valorisation globale</b>
Bilatéral	62.140.335
<b>Total</b>	<b>62.140.335</b>

#### **Données sur la réutilisation des garanties (en CHF)**

Les garanties reçues en contrepartie d'opérations de prêt de titres ne sont pas réutilisées.

#### **Conservation des garanties reçues par l'OPC au titre des opérations de financement sur titres (SFT) (en CHF):**

<b>Nom des banques dépositaires</b>	<b>Montant des garanties conservées au titre des actifs</b>
RBC INVESTOR SERVICES BANK S.A	70.253.867

<b>Type de compte</b>
Comptes séparés

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Informations non révisées complémentaires (suite)

#### Règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation et modifiant le règlement (UE) no 648/2012 (suite)

#### Informations relatives aux rendements et aux frais associés à chaque opération de financement sur titres (SFT) (en CHF):

Nom du compartiment	Revenus bruts	Commission de l'agent (RBC)	Rendement net du fonds
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (CHF)	7.870	708	7.162
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (EUR)	856	82	774
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Relax (USD)	620	54	566
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (CHF)	58.395	5.256	53.139
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Select (EUR)	12.957	1.238	11.719
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (CHF)	48.735	4.386	44.349
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Balance (EUR)	9.355	894	8.461
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (CHF)	4.811	433	4.378
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Ambition (EUR)	506	48	458
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (CHF)	2.917	263	2.654
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Responsible Focus (EUR)	207	20	187
<b>Total</b>	<b>147.229</b>	<b>13.382</b>	<b>133.847</b>

# Swisscanto (LU) Portfolio Fund

## Rapport du Réviseur d'Entreprises agréé

Aux porteurs de parts de  
Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### *Opinion*

Nous avons révisé les comptes annuels de Swisscanto (LU) Portfolio Fund et de ses compartiments (le « Fonds »), comprenant l'état du portefeuille-titres au 31 mars 2020, l'état des opérations et des variations de l'actif net du Fonds pour l'exercice clos à cette date, ainsi que l'annexe comportant un résumé des principales méthodes comptables.

A notre avis, les comptes annuels ci-joints donnent une image fidèle de la situation patrimoniale et financière du Fonds et de chacun de ses compartiments au 31 mars 2020, ainsi que des leurs résultats et de l'évolution de l'actif net du Fonds pour l'exercice clôturé à cette date, conformément aux prescriptions légales et réglementaires en vigueur au Luxembourg concernant l'établissement et la présentation des comptes annuels.

### *Fondement de l'opinion*

Nous avons effectué notre audit conformément à la loi relative à la profession de l'audit (la « Loi du 23 juillet 2016 ») et aux normes internationales d'audit (« ISA ») adoptées par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (la « CSSF ») pour le Luxembourg. Notre responsabilité en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA est décrite plus en détail à la section « Responsabilité du Réviseur d'Entreprises agréé relative à l'audit des comptes annuels ». Nous sommes indépendants du Fonds conformément au Code de déontologie des professionnels comptables publié par le Conseil des normes internationales de déontologie comptable (« Code de l'IESBA ») adopté par la CSSF pour le Luxembourg et aux règles de conduite que nous sommes tenus d'appliquer dans le cadre de l'audit des comptes annuels, et avons satisfait aux diverses obligations professionnelles conformément à ces règles. Nous estimons que les éléments probants que nous avons recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

### *Autres informations*

Le Conseil d'Administration de la Société de gestion est responsable des autres informations. Les autres informations contiennent les informations qui figurent dans le rapport annuel, mais ne contiennent pas les comptes annuels ni le rapport du Réviseur d'Entreprises agréé sur ces comptes annuels.

Notre opinion sur les comptes annuels ne couvre pas les autres informations et nous ne fournissons aucune garantie eu égard à ces informations.

En relation avec l'audit des comptes annuels, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et à évaluer s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les comptes annuels ou les conclusions de l'audit des comptes annuels ou, par ailleurs, si les autres informations présentent des anomalies significatives. Si, sur la base des contrôles effectués par nos soins, nous devons conclure que les autres informations présentent des anomalies significatives, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à déclarer à cet égard.

### *Responsabilité du Conseil d'Administration de la Société de gestion au titre des états financiers*

Le Conseil d'Administration de la Société de gestion est responsable de l'établissement et de la présentation sincère des comptes annuels, conformément aux prescriptions légales et réglementaires en matière d'établissement des comptes annuels en vigueur au Luxembourg, ainsi que du contrôle interne que le Conseil d'Administration de la Société de gestion juge nécessaire afin de permettre l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, intentionnelles ou non.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport du Réviseur d'Entreprises agréé (suite)

Lors de l'établissement des comptes annuels, le Conseil d'Administration de la Société de gestion est responsable de l'évaluation de la capacité du Fonds et de chacun de ses compartiments à poursuivre ses activités et, lorsqu'ils sont pertinents, à rendre compte de faits en relation avec la continuité d'exploitation et à utiliser le principe de la continuité d'exploitation en comptabilité, pour autant que le Conseil d'Administration de la Société de gestion n'envisage pas de liquider le Fonds ou un de ses compartiments, de cesser son activité ou qu'il n'ait plus d'autre alternative réaliste à ces deux options.

#### *Responsabilité du Réviseur d'Entreprises agréé relative à l'audit des comptes annuels*

L'objectif de notre audit consiste à obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels dans leur ensemble ne contiennent pas d'anomalies significatives, intentionnelles ou non, et à établir à ce sujet un rapport du Réviseur d'Entreprises agréé qui contient notre opinion. Une assurance raisonnable est un niveau d'assurance élevé, mais non une garantie que l'audit effectué conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et selon les normes ISA adoptées par la CSSF pour le Luxembourg pourra toujours déceler une anomalie significative, le cas échéant. Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et sont considérées comme étant significatives si, prises individuellement ou collectivement, l'on pourrait raisonnablement s'attendre à ce qu'elles influent sur les décisions économiques des destinataires prises sur la base de ces comptes annuels.

Dans le cadre d'un audit effectué conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux normes ISA adoptées par la CSSF pour le Luxembourg, nous exerçons notre appréciation professionnelle et maintenons une attitude critique. En outre:

- Nous identifions et évaluons le risque d'anomalies significatives dans les comptes annuels, qu'elles résultent de fraudes ou d'erreurs, et nous définissons et réalisons des procédures d'audit en réponse à ces risques et recueillons des éléments probants durant notre audit qui sont suffisants et pertinents pour étayer nos opinions. Le risque de ne pas détecter une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que pour une anomalie résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, des faux, des omissions intentionnelles, de fausses déclarations ou le contournement des contrôles internes.
- Nous effectuons des analyses afin de comprendre les procédures de contrôle internes pertinentes pour notre audit dans le but de concevoir des procédures d'audit appropriées dans les circonstances données, mais non pour exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds.
- Nous apprécions la pertinence des méthodes comptables utilisées par le Conseil d'Administration de la Société de gestion ainsi que des estimations comptables et des notes en annexe y relatives.
- Nous tirons des conclusions quant à la pertinence de l'utilisation par le Conseil d'Administration de la Société de gestion du principe de continuité d'exploitation dans le cadre de l'établissement des comptes annuels. Nous tirons également une conclusion, sur la base des éléments probants recueillis, sur l'existence ou non d'une incertitude significative concernant les événements ou les conditions qui pourraient faire planer le doute quant à la capacité du Fonds ou d'un de ses compartiments de poursuivre son activité. Si nous concluons à l'existence d'une telle incertitude significative, nous avons l'obligation d'attirer l'attention, dans notre rapport du Réviseur d'Entreprises agréé, sur les notes en annexe aux comptes annuels correspondantes ou, si ces informations sont insuffisantes, de modifier notre opinion. Nos conclusions reposent sur les éléments probants recueillis jusqu'à la date d'établissement de notre rapport du Réviseur d'Entreprises agréé. Cependant, des événements ou des conditions futurs peuvent conduire à la cessation de la continuité de l'exploitation du Fonds ou l'un de ses compartiments (à l'exception des compartiments pour lesquels une liquidation est déjà décidée ou prévue)
- Nous évaluons la présentation, la structure et le contenu des comptes annuels dans leur ensemble, y compris les notes en annexe, et décidons si ces comptes annuels reflètent fidèlement les transactions et les événements sous-jacents.

## Swisscanto (LU) Portfolio Fund

### Rapport du Réviseur d'Entreprises agréé (suite)

- S'agissant des compartiments pour lesquels une liquidation est déjà décidée ou prévue, nous jugeons du bien-fondé de l'application du principe comptable de continuité de l'exploitation par le Conseil d'Administration de la Société de gestion. Nous évaluons également l'adéquation des informations fournies dans les notes s'agissant de la description de l'application du principe comptable de non-continuité de l'exploitation ainsi que les motifs de son application. Nos conclusions reposent sur les éléments probants recueillis jusqu'à la date d'établissement de notre rapport du Réviseur d'Entreprises agréé.

Nous communiquons aux entités responsables de la surveillance, entre autres, la portée et le calendrier prévus de l'audit ainsi que les constatations significatives, y compris les lacunes majeures dans le système de contrôle interne que nous identifions pendant l'audit.

Ernst & Young  
Société anonyme  
Cabinet de révision agréé

Nadia Faber

Luxembourg, le 28 juillet 2020