
Swisscanto (LU)

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

Rapport semi-annuel non révisé au 30 septembre 2022

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)

Table des matières

	Page
Organisation	3
Informations générales	5
Etat du patrimoine	7
Etat des opérations et des autres variations de l'actif net	8
Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation pour la période clôturée au 30 septembre 2022	9
Statistiques	10
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	11
Etat du portefeuille-titres	11
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	14
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection	15
Etat du portefeuille-titres	15
Répartition géographique et économique du portefeuille-titres	21
Notes aux Etats Financiers semestriels	22
Informations complémentaires	30

Swisscanto (LU)

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

Martin Friedli, Suisse, Directeur de la gestion des produits Fonds, Zürcher Kantonalbank, Zurich

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

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

Swisscanto (LU)

Organisation (suite)

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

Réviser d'entreprises indépendant

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

Swisscanto (LU)

Informations générales

Fonds de placement de droit luxembourgeois à compartiments multiples (« Umbrella Fund »)

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

Le règlement du Fonds a été défini le 5 décembre 2006 par la société de gestion.

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) 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 Fonds ne peuvent être proposées, vendues ou livrées sur le territoire des Etats-Unis ou à des personnes considérées comme des Ressortissants américains, en vertu de la Réglementation S du US Securities Act de 1933 ou du US Commodity Exchange Act, dans leur version actuelle.

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 indemnisations pour la commercialisation du Fonds sont payées à partir des frais d'administration centrale. Par ailleurs, la direction du Fonds a l'intention d'octroyer, à partir des frais d'administration centrale, une rétrocession aux investisseurs institutionnels qui conservent des parts du Fonds pour le compte de tiers.

Swisscanto (LU)

Informations générales (suite)

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0338548034
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999461055
Numéro ISIN:	Classe DT:	LU0338548117
Numéro ISIN:	Classe GT:	LU0866273294
Numéro ISIN:	Classe JT:	LU1458526925
Numéro ISIN:	Classe MT:	LU2099034824
Numéro ISIN:	Classe NT:	LU0866272569

Numéro de valeur:	Classe AT:	3650277
Numéro de valeur:	Classe BT:	23115375
Numéro de valeur:	Classe DT:	3650280
Numéro de valeur:	Classe GT:	20252840
Numéro de valeur:	Classe JT:	33386918
Numéro de valeur:	Classe MT:	51747447
Numéro de valeur:	Classe NT:	20252839

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Numéro ISIN:	Classe AT:	LU0562145853
Numéro ISIN:	Classe BT:	LU0999461139
Numéro ISIN:	Classe DT:	LU0562149921
Numéro de valeur:	Classe AT:	12041875
Numéro de valeur:	Classe BT:	23115403
Numéro de valeur:	Classe DT:	12041876

Swisscanto (LU)

Etat du patrimoine
au 30 septembre 2022

		Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection	Consolidé
	Note	USD	CHF	CHF
ACTIFS				
Etat du portefeuille-titres à la valeur de marché	(2)	367.587.647	16.705.462	378.503.615
Avoirs bancaires		14.844.266	844.637	15.455.106
A recevoir sur émissions de parts		19.484	0	19.177
Revenus à recevoir sur portefeuilletitres		1.048.013	54.456	1.085.963
Plus-value non réalisée sur les contrats de change à terme	(7)	0	68.950	68.950
Autres actifs nets		1.157.215	160	1.139.149
TOTAL DE L'ACTIF		384.656.625	17.673.665	396.271.960
EXIGIBLE				
Options (options vendues) à la valeur du marché	(8)	0	27	27
A payer sur achats de titres		14.413.709	0	14.186.694
Paiements en attente sur le rachat de parts		10.490	0	10.325
Moins-values non réalisées sur contrats de change à terme	(7)	8.260	0	8.130
Autres frais à payer		597.803	18.391	606.778
TOTAL DE L'EXIGIBLE		15.030.262	18.418	14.811.954
ACTIFS NETS À LA FIN DE LA PERIODE		369.626.363	17.655.247	381.460.006
Valeur nette d'inventaire par part				
Classe AT		120,55	93,18	
Classe BT		102,82	96,50	
Classe DT		134,68	98,99	
Classe GT		107,55	-	
Classe JT		132,19	-	
Classe MT		86,39	-	
Classe NT		103,54	-	
Nombre de parts en circulation				
Classe AT		142.864	183.901	
Classe BT		6.943	615	
Classe DT		214.259	4.650	
Classe GT		496.854	-	
Classe JT		10	-	
Classe MT		11.970	-	
Classe NT		2.591.770	-	

Swisscanto (LU)

Etat des opérations et des autres variations de l'actif net
du 1 avril 2022 au 30 septembre 2022

		Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection	Consolidé
	Note	USD	CHF	CHF
ACTIFS NETS AU DEBUT DE LA PERIODE		398.491.884	21.221.635	387.933.870
REVENUS				
Dividendes, nets		5.745.311	72.782	5.727.604
Intérêts sur obligations et autres titres, nets		0	96.870	96.870
Intérêts bancaires		76.464	2.615	77.875
Autres revenus		617	8	615
TOTAL DES REVENUS		5.822.392	172.275	5.902.964
CHARGES				
Frais sur transactions		8.611	9.462	17.937
Frais d'administration centrale	(4)	439.252	105.711	538.045
Taxe d'abonnement	(3)	23.535	4.482	27.646
Intérêts bancaires payés		1.096	1.651	2.730
Autres charges		180	0	177
TOTAL DES CHARGES		472.674	121.306	586.535
REVENUS NETS DES INVESTISSEMENTS		5.349.718	50.969	5.316.429
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur portefeuille-titres		(9.446.665)	(535.866)	(9.833.746)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur changes à terme		(88.463)	(119.674)	(206.744)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur devises		(190.719)	46.745	(140.970)
Bénéfice/(Perte) net(te) réalisé(e) sur options		0	92.718	92.718
BENEFICE/(PERTE) NET(TE) REALISE(E)		(4.376.129)	(465.108)	(4.772.313)
Variation nette de la plus-value/(moins-value) non réalisée				
- sur portefeuille-titres		(86.518.750)	(2.159.335)	(87.315.417)
- sur changes à terme		(8.260)	(7.525)	(15.655)
- sur options		0	173.066	173.066
AUGMENTATION/DIMINUTION NETTE DE L'ACTIF NET		(90.903.139)	(2.458.902)	(91.930.319)
Emissions	(2)	94.273.376	66.224	92.854.797
Rachats	(2)	(32.235.758)	(1.173.710)	(32.901.756)
Ecart de réévaluation	(2)	0	0	25.503.414
ACTIFS NETS À LA FIN DE LA PERIODE		369.626.363	17.655.247	381.460.006

Swisscanto (LU)

Changements intervenus dans le nombre de parts en circulation pour la période clôturée au 30 septembre 2022

	Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection
Classe AT Nombre de parts en circulation au début de la période	140.359	194.918
Nombre de parts émises	5.228	656
Nombre de parts rachetées	(2.723)	(11.673)
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	142.864	183.901
Classe BT Nombre de parts en circulation au début de la période	6.928	609
Nombre de parts émises	16	6
Nombre de parts rachetées	(1)	0
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	6.943	615
Classe DT Nombre de parts en circulation au début de la période	100.444	4.650
Nombre de parts émises	136.715	0
Nombre de parts rachetées	(22.900)	0
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	214.259	4.650
Classe GT Nombre de parts en circulation au début de la période	18.743	0
Nombre de parts émises	492.109	0
Nombre de parts rachetées	(13.998)	0
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	496.854	0
Classe JT Nombre de parts en circulation au début de la période	17	0
Nombre de parts émises	0	0
Nombre de parts rachetées	(7)	0
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	10	0
Classe MT Nombre de parts en circulation au début de la période	11.970	0
Nombre de parts émises	0	0
Nombre de parts rachetées	0	0
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	11.970	0
Classe NT Nombre de parts en circulation au début de la période	2.711.601	0
Nombre de parts émises	109.298	0
Nombre de parts rachetées	(229.129)	0
Nombre de parts en circulation à la fin de la période	2.591.770	0

Swisscanto (LU)

Statistiques

	Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection
	USD	CHF
ACTIF NET		
30 septembre 2022	369.626.363	17.655.247
31 mars 2022	398.491.884	21.221.635
31 mars 2021	475.232.398	29.557.615
Valeur nette d'inventaire par part		
30 septembre 2022		
Classe AT	120,55	93,18
Classe BT	102,82	96,50
Classe DT	134,68	98,99
Classe GT	107,55	-
Classe JT	132,19	-
Classe MT	86,39	-
Classe NT	103,54	-
31 mars 2022		
Classe AT	153,96	105,86
Classe BT	130,81	109,42
Classe DT	171,07	112,13
Classe GT	136,50	-
Classe JT	168,00	-
Classe MT	109,23	-
Classe NT	130,89	-
31 mars 2021		
Classe AT	180,81	108,74
Classe BT	152,44	111,94
Classe DT	198,74	114,50
Classe GT	158,34	-
Classe JT	195,36	-
Classe MT	125,76	-
Classe NT	150,62	-
TER par part		
Classe AT	2,07%	1,15%
Classe BT	1,29%	0,75%
Classe DT	0,96%	0,56%
Classe GT	0,79%	-
Classe JT	1,06%	-
Classe MT	0,05%	-
Classe NT	0,01%	-

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Etat du portefeuille-titres
au 30 septembre 2022

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire						
Actions						
Afrique du Sud						
ZAE000042164	Mtn Group Ltd	830.117	ZAR	9.252.939	5.537.082	1,50
				9.252.939	5.537.082	1,50
Bermudes						
BMG2519Y1084	Credicorp	60.100	USD	7.495.966	7.380.280	2,00
				7.495.966	7.380.280	2,00
Brésil						
BRBBASACNOR3	Banco Do Brasil Sa	994.600	BRL	6.262.494	7.083.198	1,92
BRCMIGACNPR3	Cia Energ Minas Gerais/pref	2.809.630	BRL	5.901.371	5.589.282	1,51
BRDXCOACNOR8	Dexco Rg	3.096.280	BRL	8.267.830	5.352.374	1,45
BRHYPEACNORO	Hypermarcas Sa	835.100	BRL	6.599.458	6.831.977	1,85
BRWEGEACNORO	Weg Sa	958.500	BRL	6.205.891	5.695.510	1,54
				33.237.044	30.552.341	8,27
Caïmans (Iles)						
KYG017191142	Alibaba Group Holding Ltd	1.126.251	HKD	24.851.708	11.183.729	3,02
KYG040111059	Anta Sports Products Ltd	576.000	HKD	6.624.756	6.104.936	1,65
KYG211311009	China Metal Recycling Holdings*	1.053.000	HKD	1.102.881	0	0,00
KYG3323L1005	Fabrinet	66.096	USD	5.258.946	6.308.863	1,71
KYG4232C1087	Haitan Intl Hldgs Ltd	1.016.563	HKD	2.786.533	1.932.139	0,52
KYG596691041	Meituan	295.400	HKD	8.284.852	6.231.695	1,69
KYG8087W1015	Shenzhen Intl Group Ltd	95.500	HKD	1.540.259	746.369	0,20
KYG8167W1380	Sino Biopharma	8.224.000	HKD	5.826.504	3.865.848	1,05
KYG875721634	Tencent Holdings Ltd	443.423	HKD	24.597.604	15.048.312	4,07
KYG970081173	Wuxi Biologics Rg	247.500	HKD	3.104.763	1.494.476	0,40
KYG9829N1025	Xinyi Solar Holdings Shs	2.295.555	HKD	3.164.214	2.430.100	0,66
				87.143.020	55.346.467	14,97
Chili						
US8336351056	Socie.Quimica Y Min/Spon.Adr-b	65.445	USD	4.094.680	5.939.134	1,61
				4.094.680	5.939.134	1,61
Chine						
CNE100003662	Contemp	96.800	CNH	7.960.676	5.472.433	1,48
CNE000001G38	Guodian Nari Technology Co -a-	2.039.538	CNH	5.461.670	7.152.987	1,93
CNE1000048K8	Haier Smart Home Co Ltd H	2.348.800	HKD	8.573.936	7.196.088	1,95
CNE0000014W7	Jiangsu Hendrui Medicine Co -a-	381.814	CNH	3.418.316	1.889.900	0,51
CNE100001FR6	Longi Green	532.124	CNH	3.829.139	3.595.165	0,97
CNE1000003X6	Ping An Insur. (Grp) Co -h-	1.346.871	HKD	11.808.717	6.725.853	1,82
CNE100000FN7	Sinopharm Group Co -h-	3.462.000	HKD	9.312.129	6.941.721	1,88
CNE1000018M7	Sungrow Power Supply Co Ltd	158.004	CNH	2.047.448	2.464.799	0,67
CNE100002BR3	Yunnan En	147.793	CNH	2.965.387	3.628.962	0,98
				55.377.418	45.067.908	12,19
Corée du Sud						
KR7021240007	Coway Reg Shs	98.804	KRW	5.853.194	3.722.549	1,01
KR7005830005	Dongbu Insurance Co Ltd	122.582	KRW	6.357.555	4.729.802	1,28
KR7012330007	Hyundai Mobis	23.460	KRW	4.343.980	3.132.121	0,85

* Veuillez noter que ce titre est décoté.

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Etat du portefeuille-titres (suite)
au 30 septembre 2022

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
KR7105560007	Kb Financial Group Inc	203.518	KRW	8.455.413	6.216.722	1,68
KR7051910008	Lg Chemical Ltd	16.225	KRW	7.658.640	6.078.923	1,64
KR7005931001	Samsung Electr./pfd n-vot.	259.145	KRW	10.572.809	8.495.577	2,30
KR7005930003	Samsung Electronics Co Ltd	141.938	KRW	6.952.038	5.268.299	1,43
KR7006400006	Samsung Sdi Co Ltd	12.047	KRW	5.487.297	4.597.786	1,24
				55.680.926	42.241.779	11,43
	Etats-Unis d'Amérique					
KYG070341048	Baidu Rg-a	182.138	HKD	4.364.711	2.647.412	0,72
				4.364.711	2.647.412	0,72
	Hong-Kong					
HK0000069689	Aia Group Ltd	537.607	HKD	5.634.861	4.482.393	1,21
HK0992009065	Lenovo Group Ltd	8.014.000	HKD	7.692.616	5.574.133	1,51
				13.327.477	10.056.526	2,72
	Inde					
INE361B01024	Divi S Laboratories Ltd	81.442	INR	5.270.800	3.709.220	1,00
INE176B01034	Havells India Ltd	329.869	INR	5.790.398	5.468.033	1,48
INE860A01027	Hcl Technologies /demat.	510.469	INR	4.799.946	5.850.203	1,58
INE030A01027	Hindustan Unilever Ltd	279.434	INR	8.630.964	9.261.774	2,51
US40415F1012	Housing Devt.fin.corp /adr	122.467	USD	6.718.530	7.154.522	1,93
INE009A01021	Infosys --- Shs	405.657	INR	7.421.893	7.047.936	1,91
INE389H01022	Kec International	336.623	INR	1.587.264	1.860.962	0,50
INE196A01026	Marico Ltd/Demat	1.140.765	INR	7.713.903	7.541.885	2,04
INE752E01010	Power Grid Corp Of India Ltd	2.802.177	INR	8.178.829	7.309.093	1,98
				56.112.527	55.203.628	14,93
	Indonésie					
ID1000095003	Pt Bank Mandiri Persero Tbk	13.767.600	IDR	7.254.503	8.521.315	2,30
ID1000118201	Pt Bank Rakyat Indonesia	27.221.625	IDR	7.215.822	8.026.522	2,17
ID1000129000	Pt Telekom Indon Persero Pt	30.865.660	IDR	7.583.759	9.040.188	2,45
				22.054.084	25.588.025	6,92
	Mexique					
MXP001691213	America Movil Sab De Cv -L-	6.117.700	MXN	5.636.731	5.059.704	1,37
MX01GE0E0004	Gentera Sab De Cv	4.715.675	MXN	3.135.003	4.073.693	1,10
MXP370711014	Grupo Fin Banorte -o-	1.388.800	MXN	7.305.735	8.932.028	2,41
MX01LA080009	Sitios Latam Rg	305.885	MXN	168.081	136.761	0,04
				16.245.550	18.202.186	4,92
	Pologne					
PLPZU0000011	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	350.664	PLN	2.544.733	1.644.335	0,44
				2.544.733	1.644.335	0,44
	Royaume-Uni					
GB00B1CRLC47	Mondi Plc	446.079	GBP	9.704.994	6.941.534	1,88
				9.704.994	6.941.534	1,88
	Taiwan					
TW0002891009	CTBC Financial Holding Co Ltd	9.205.067	TWD	6.834.933	5.755.150	1,56
TW0002308004	Delta Electronic Industrial	985.000	TWD	6.972.393	7.849.210	2,12
TW0002383007	Elite Material Co Ltd	440.548	TWD	2.363.032	2.220.150	0,60
TW0009921007	Giant Manufacture Co Ltd	553.000	TWD	5.771.499	3.579.366	0,97

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Etat du portefeuille-titres (suite) au 30 septembre 2022

(exprimé en USD)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
TW0002330008	Taiwan Semicond.manufact	310.000	TWD	5.237.442	4.120.438	1,12
US8740391003	Taiwan Semiconduct.manuf/sadr	311.332	USD	22.949.819	21.344.922	5,77
				50.129.118	44.869.236	12,14
	Thaïlande					
TH0016010017	Kasikornbank Plc /For Reg	1.547.000	THB	6.005.066	5.905.802	1,60
				6.005.066	5.905.802	1,60
	Total - Actions			432.770.253	363.123.675	98,24
	Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire			432.770.253	363.123.675	98,24
	Autres valeurs mobilières					
	Actions					
	Caïmans (Iles)					
KYG8208B1014	Jd.Com Rg-a	176.444	HKD	5.871.749	4.463.972	1,21
				5.871.749	4.463.972	1,21
	Total - Actions			5.871.749	4.463.972	1,21
	Total - Autres valeurs mobilières			5.871.749	4.463.972	1,21
	TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES			438.642.002	367.587.647	99,45

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Répartition géographique et économique du portefeuille-titres au 30 septembre 2022

(en pourcentage de l'actif net)

Répartition géographique	%	Répartition économique	%
Caïmans (Iles)	16,18	Banques et autres institutions financières	14,33
Inde	14,93	Semi-conducteur électronique	12,87
Chine	12,19	Internet Software	9,97
Taiwan	12,14	Electrotechnique, électronique	9,53
Corée du Sud	11,43	Holdings et sociétés financières	6,85
Brésil	8,27	Mécanique, outillage	5,47
Indonésie	6,92	Transmission de nouvelles	5,32
Mexique	4,92	Assurances	4,75
Hong-Kong	2,72	Pharmacie et cosmétique	4,44
Bermudes	2,00	Chimie	3,25
Royaume-Uni	1,88	Services divers	3,02
Chili	1,61	Energie et service des eaux	2,65
Thaïlande	1,60	Alimentation, boissons	2,04
Afrique du Sud	1,50	Papier et bois	1,88
Etats-Unis d'Amérique	0,72	Textile et habillement	1,85
Pologne	0,44	Biens de consommation divers	1,85
	99,45	Métaux non ferreux	1,51
		Articles de bureau et ordinateurs	1,51
		Construction, matériel de construction	1,45
		Sociétés immobilières	1,21
		Industrie De L'Emballage	0,98
		Circulation et transport	0,97
		Véhicules routiers	0,85
		Autres sociétés de commerce	0,50
		Biotechnologie	0,40
			99,45

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Etat du portefeuille-titres
au 30 septembre 2022

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire						
Actions						
Allemagne						
DE0005664809	Evotec I Inhaber-akt	831	EUR	34.893	14.387	0,08
DE0006231004	Infineon Technologies /nam.	1.535	EUR	54.077	33.613	0,19
DE0007236101	Siemens Ag /nam.	503	EUR	71.420	49.082	0,28
DE000ENER6Y0	Siemens Energy Ag	1.114	EUR	12.473	12.229	0,07
				172.863	109.311	0,62
Canada						
CA0641491075	Bank Of Nova Scotia	590	CAD	39.782	27.767	0,16
CA6330671034	National Bank Of Canada	940	CAD	69.345	58.297	0,33
CA7751092007	Rogers Commun. /B. N-V. *Opr*	905	CAD	42.642	34.494	0,19
				151.769	120.558	0,68
Danemark						
DK0060534915	Novo Nordisk A/S /-B-	309	DKK	31.672	30.510	0,17
DK0060094928	Orsted	424	DKK	42.835	33.402	0,19
DK0061539921	Vestas Wind Br/Rg	1.333	DKK	43.542	24.481	0,14
				118.049	88.393	0,50
Etats-Unis d'Amérique						
US00287Y1091	Abbvie Inc	619	USD	71.489	81.768	0,46
US0010551028	Aflac Inc.	1.278	USD	64.948	70.692	0,40
US0126531013	Albemarle Corp	246	USD	51.544	64.028	0,36
US02079K3059	Alphabet Inc -a-	1.845	USD	235.555	173.695	0,98
US0304201033	American Water Works Co Inc	270	USD	42.256	34.590	0,20
US0378331005	Apple Inc	522	USD	72.100	71.004	0,40
US0382221051	Applied Materials Inc	411	USD	50.214	33.143	0,19
US0528001094	Autoliv Inc	408	USD	35.196	26.757	0,15
US15135B1017	Centene Corp. De	836	USD	50.738	64.025	0,36
US17275R1023	Cisco Systems Inc.	814	USD	41.136	32.047	0,18
US2441991054	Deere & Co.	143	USD	44.522	46.994	0,27
US27579R1041	East-West Bancorp	915	USD	67.829	60.466	0,34
US2786421030	Ebay Inc	879	USD	60.511	31.846	0,18
US29261A1007	Encompass Hlth Registered	268	USD	13.910	11.931	0,07
US29332G1022	Enhabit Rg-Wi	159	USD	4.032	2.197	0,01
US29670G1022	Essential Util Rg	395	USD	17.403	16.088	0,09
US3364331070	First Solar Inc	649	USD	67.486	84.491	0,48
US3687361044	General Hldg	365	USD	124.752	63.997	0,36
US4592001014	Ibm Corp	169	USD	23.164	19.763	0,11
US4932671088	Keycorp	1.558	USD	33.153	24.566	0,14
US49338L1035	Keysight Technologies Inc	533	USD	81.843	82.552	0,47
US4943681035	Kimberly Clark Corp	367	USD	47.206	40.652	0,23
US5486611073	Lowe S Companies Inc.	330	USD	64.900	61.001	0,35
US5717481023	Marsh & Mc-Lennan Cos Inc	415	USD	61.077	60.980	0,35
US30303M1027	Meta Platforms Registered Shs A	190	USD	55.454	25.373	0,14
US5951121038	Micron Technology Inc	762	USD	48.596	37.575	0,21
US5949181045	Microsoft Corp.	912	USD	246.749	209.059	1,18
US61945C1036	Mosaic Co	1.430	USD	53.973	68.023	0,39
US67066G1040	Nvidia Corp.	391	USD	72.020	46.716	0,26

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Etat du portefeuille-titres (suite)
au 30 septembre 2022

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
US6907421019	Owens Corning Inc	608	USD	50.105	47.042	0,27
US70450Y1038	Paypal Holdings Inc	100	USD	8.993	8.471	0,05
US7170811035	Pfizer Inc.	1.515	USD	74.300	65.252	0,37
US78409V1044	S&P Global Shs	182	USD	73.291	54.698	0,31
US83417M1045	Solaredge Technologies Inc	285	USD	81.568	64.927	0,37
US78486Q1013	Svb Financial Group	62	USD	38.570	20.490	0,12
US88160R1014	Tesla Inc	225	USD	64.468	58.741	0,33
US8835561023	Thermo Fisher Scientific Inc	189	USD	101.707	94.349	0,53
US8923561067	Tractor Supply Co	423	USD	78.176	77.389	0,44
US9113631090	United Rentals Inc.	228	USD	72.643	60.617	0,34
US91324P1021	Unitedhealth Group Inc	248	USD	95.945	123.277	0,70
US92343V1044	Verizon Communications Inc	2.080	USD	100.670	77.734	0,44
US92532F1003	Vertex Pharmaceuticals	313	USD	74.671	89.199	0,51
US92826C8394	Visa Inc -a	210	USD	44.128	36.719	0,21
US94106L1098	Waste Management Inc	161	USD	24.337	25.388	0,14
				2.887.328	2.550.312	14,44
	France					
FR0000120628	Axa	1.874	EUR	48.028	40.611	0,23
CA6665111002	Northland Power	412	CAD	13.342	11.938	0,07
FR0000121972	Schneider Electric Se	149	EUR	22.864	16.801	0,09
				84.234	69.350	0,39
	Irlande					
IE00B4BNMY34	Accenture Plc	351	USD	107.391	88.890	0,51
IE0004927939	Kingspan Group Plc	211	EUR	20.478	9.428	0,05
IE00BZ12WP82	Linde Plc	153	EUR	42.523	41.189	0,23
IE00BZ12WP82	Linde Plc	71	USD	20.513	18.839	0,11
				190.905	158.346	0,90
	Japon					
JP3942400007	Astellas Pharma Inc	3.400	JPY	52.903	44.320	0,25
US0476491081	Atkore Inc	567	USD	55.180	43.424	0,25
JP3358000002	Shimano Inc.	200	JPY	51.154	30.926	0,17
JP3435000009	Sony Group Registered Shs	1.000	JPY	102.671	63.144	0,36
JP3910660004	Tokio Marine Holdings Inc	1.800	JPY	30.043	31.395	0,18
JP3571400005	Tokyo Electron Co Ltd	200	JPY	85.237	48.551	0,27
				377.188	261.760	1,48
	Luxembourg					
FR0014000MR3	Eurofins Scientific	346	EUR	40.509	20.391	0,12
				40.509	20.391	0,12
	Pays-Bas					
NL0010273215	Asml Holding Nv	115	EUR	80.936	48.080	0,27
NL0011821202	Ing Group Nv	1.733	EUR	23.644	14.802	0,08
NL0011794037	Koninklijke Ahold Delhaize N.V.	1.942	EUR	58.406	48.938	0,28
NL0000009827	Koninklijke Dsm Nv	116	EUR	22.689	13.137	0,08
				185.675	124.957	0,71
	Royaume-Uni					
GB0009895292	Astrazeneca Plc	612	GBP	68.093	66.865	0,38
CH0371153492	Landis+Gyr Group Ltd	115	CHF	7.104	6.187	0,03

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Etat du portefeuille-titres (suite)
au 30 septembre 2022

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
GB0008706128	Lloyds Banking Group Plc	34.036	GBP	21.541	15.478	0,09
GB00B10RZP78	Unilever Plc	1.925	EUR	90.106	83.934	0,48
				186.844	172.464	0,98
Singapour						
SG1S04926220	Oversea-Chinese Bk Corp	7.000	SGD	56.131	56.802	0,32
				56.131	56.802	0,32
Suède						
SE0000695876	Alfa Laval Ab	523	SEK	17.826	12.914	0,07
SE0017768716	Boliden Rg	2.054	SEK	81.221	63.131	0,36
SE0015988019	Nibe Industrie Rg-B	3.324	SEK	35.569	29.510	0,17
				134.616	105.555	0,60
Suisse						
CH0012221716	Abb	4.429	CHF	139.583	114.268	0,65
CH0432492467	Alcon Inc.	1.763	CHF	130.047	102.501	0,58
CH1176493729	Bachem Hldg N	247	CHF	19.177	15.512	0,09
CH1101098163	Belimo Hldg N	77	CHF	31.097	28.297	0,16
CH0030486770	Daetwyler Holding Ag	114	CHF	28.166	18.080	0,10
CH0126673539	Dksh Holding Ltd Shs	616	CHF	49.553	44.229	0,25
CH0003541510	Forbo Holding Ag /nam. *Opr*	14	CHF	25.575	15.008	0,08
CH0360674466	Galenica Sante Ltd.	434	CHF	29.147	31.139	0,18
CH0030170408	Geberit Ag/namen-aktien	30	CHF	19.587	12.825	0,07
CH1169151003	Georg Fischer N	320	CHF	21.497	15.232	0,08
CH0010645932	Givaudan Sa /Reg.	10	CHF	41.091	30.030	0,17
CH1173567111	Gurit Hldg N	66	CHF	11.272	4.785	0,03
CH0012214059	Holcim N Namen-Akt	564	CHF	25.750	23.113	0,13
CH0006372897	Interroll Holding Ltd/Nam.	15	CHF	42.712	28.350	0,16
CH0025751329	Logitech Intl Sa	1.116	CHF	79.774	51.280	0,29
CH0013841017	Lonza Group Ag /nom.	239	CHF	145.040	116.226	0,66
CH0108503795	Meyer Burger	44.965	CHF	19.497	17.788	0,10
CH0038863350	Nestle / Act Nom	6.032	CHF	697.082	645.907	3,66
CH0012005267	Novartis Ag Basel/nam.	6.014	CHF	466.991	454.237	2,57
CH0024608827	Partners Group Holding	36	CHF	41.203	28.966	0,16
CH0012032048	Roche Holding Ag /Genussschein	1.604	CHF	553.292	518.814	2,94
CH0014284498	Siegfried Holding Sa /Nam.Akt.	74	CHF	56.417	54.390	0,31
CH0435377954	Sig Combibloc Group Ag	3.476	CHF	81.618	70.146	0,40
CH0418792922	Sika Ltd	353	CHF	109.031	70.847	0,40
CH0013396012	Skan Group N	217	CHF	16.462	12.543	0,07
CH0012549785	Sonova Holding Ag /nom.	246	CHF	81.041	54.120	0,31
CH0014852781	Swiss Life Holding /nam	165	CHF	84.713	72.352	0,41
CH0008742519	Swisscom /nam.	66	CHF	34.927	30.591	0,17
CH0012100191	Tecan Group Sa /nam.	202	CHF	68.654	69.286	0,39
CH0012453913	Temenos Ltd	417	CHF	34.024	28.122	0,16
CH0244767585	Ubs Group Ag	7.414	CHF	114.568	107.318	0,61
CH0276534614	Zehnder Group Ag	760	CHF	71.639	38.304	0,22
CH0011075394	Zurich Insurance Group/nam	451	CHF	176.845	178.145	1,01
				3.547.072	3.102.751	17,57
Total - Actions				8.133.183	6.940.950	39,31

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Etat du portefeuille-titres (suite)
au 30 septembre 2022

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
Obligations						
Allemagne						
DE0001102432	Germany 1.25% 17-15.08.48	99.405	EUR	151.813	80.074	0,45
US500769GQ12	Kfw 2% 15-02.05.25	400.000	USD	388.899	372.066	2,11
US500769CG75	Kfw 2.6% 07-20.06.37	50.000.000	JPY	578.368	435.876	2,47
US515110BP87	Lwf Rentbk 2.375% 15-10.06.25	450.000	USD	452.124	421.507	2,39
				1.571.204	1.309.523	7,42
Australie						
XS2342206591	Westpac Bk 0.766% 21-13.05.31	100.000	EUR	102.875	81.716	0,46
				102.875	81.716	0,46
Belgique						
EU000A3K4DD8	Eu 1.0% 22-06.07.32	100.000	EUR	85.731	80.841	0,46
				85.731	80.841	0,46
Canada						
CA135087L369	Canada 0.25% 20-01.11.22	200.000	CAD	146.380	142.938	0,81
CA135087D358	Gov Canada 2.75% 14-01.12.48 D358	150.000	CAD	128.919	100.253	0,57
				275.299	243.191	1,38
Chili						
XS2369244087	Chile 0.10% 21-26.01.27	200.000	EUR	187.512	161.709	0,92
				187.512	161.709	0,92
Corée du Sud						
US500630CW64	Kdb 3.25% 19-19.02.24	200.000	USD	201.268	193.417	1,10
				201.268	193.417	1,10
Etats-Unis d'Amérique						
US02079KAG22	Alphabet 2.25% 20-15.08.60	120.000	USD	96.969	66.938	0,38
US94973VBF31	Anthem Inc 5.1% 13-15.01.44 Sr	400.000	USD	487.157	357.932	2,03
XS0291949120	At&T 5.5% 07-15.03.27	150.000	GBP	230.172	157.405	0,89
XS2348234936	Bac 1.667% 21-02.06.29	120.000	GBP	152.953	100.923	0,57
US075887CL11	Becton Dick 1.957% 21-11.02.31	75.000	USD	68.001	56.788	0,32
US172967MD09	Citigroup I 4.65% 18-23.07.48	100.000	USD	101.281	80.048	0,45
US594918BR43	Microsoft 2.4% 16-08.08.26	150.000	USD	151.737	136.667	0,78
XS2439004685	Prologis Eu 1.50% 22-08.02.34	100.000	EUR	76.184	70.594	0,40
US92343VGK44	Verizon Com 3.40% 21-22.03.41	450.000	USD	430.015	323.818	1,84
US92826CAL63	Visa Inc 1.90% 20-15.04.27	350.000	USD	343.666	305.994	1,73
				2.138.135	1.657.107	9,39
France						
FR0013509890	Afd 0.75% 20-28.04.23 Regs	200.000	USD	184.225	193.007	1,09
CH0127860192	Cades 2.375% 11-19.04.23	100.000	CHF	120.386	100.760	0,57
				304.611	293.767	1,66
Italie						
XS2360310044	Unicredit 0.80% 21-05.07.29	200.000	EUR	220.215	150.162	0,85
				220.215	150.162	0,85
Japon						
XS0241265445	East Jap.Railway 4.5% 06-25.01.36	200.000	GBP	333.505	194.576	1,10
				333.505	194.576	1,10

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Etat du portefeuille-titres (suite)
au 30 septembre 2022

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
Luxembourg						
XS0282506657	Bei 2.15% 07-18.01.27 Senior	20.000.000	JPY	189.193	148.229	0,84
XS1280834992	Eib 0.5% 15-15.11.23 Regs	50.000	EUR	57.345	47.373	0,27
XS2332164966	Eib 2.70% 21-22.04.24	1.000.000	CNH	143.877	139.021	0,79
				390.415	334.623	1,90
Norvège						
XS2432567555	Dnb Bank As 0.375% 22-18.01.28	200.000	EUR	203.608	167.930	0,95
XS2189767515	Kommunalbk 1.125% 20-14.06.30	204.000	USD	184.125	161.180	0,91
				387.733	329.110	1,86
Pays-Bas						
XS2199719233	Bng 0.125% 20-09.07.35	250.000	EUR	262.802	166.053	0,94
XS0877608124	Bng 2.5% 13-23.01.23 Regs	300.000	USD	281.831	294.058	1,67
XS2428716000	Digital Int 1.375% 22-18.07.32	100.000	EUR	78.579	65.656	0,37
NL0011220108	Netherlands 0.25% 15-15.07.25	50.000	EUR	57.719	46.121	0,26
				680.931	571.888	3,24
Philippines						
XS0307424274	Asian Dev Bk 2.35% 07-21.06.27	30.000.000	JPY	288.137	225.033	1,27
				288.137	225.033	1,27
Royaume-Uni						
XS2343772724	Asb Fin 0.25% 21-21.05.31	100.000	EUR	84.129	74.366	0,42
XS2288938546	Ebrd 2.0% 21-21.01.25	1.000.000	CNH	140.889	135.299	0,77
XS0222383027	Glaxosm Cap 4% 05-16.06.25	300.000	EUR	377.262	296.807	1,68
XS2333299324	Iffim 1.0% 21-21.04.26	100.000	USD	90.294	87.521	0,49
				692.574	593.993	3,36
Total - Obligations				7.860.145	6.420.656	36,37
Total - Valeurs mobilières admises à la cote officielle et négociées sur d'autres marchés réglementés et instruments du marché monétaire				15.993.328	13.361.606	75,68
Fonds de placement						
Luxembourg						
LU0866272569	Swisscanto (Lu) Equity Fund Sustainable Emerging Markets Nt	4.947	USD	663.461	502.045	2,84
LU1877924016	Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit Nt	17.315	CHF	2.011.586	1.641.816	9,30
				2.675.047	2.143.861	12,14
Total - Parts de fonds				2.675.047	2.143.861	12,14
Options						
Suisse						
EU0009658145	DJ EURO STOXX 50	8	EUR	19.816	17.803	0,10
EU0009658145	DJ EURO STOXX 50	8	EUR	17.297	16.415	0,09
EU0009658145	DJ EURO STOXX 50	8	EUR	17.192	23.990	0,14
CH0009980894	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	10	CHF	39.700	43.440	0,25
CH0009980894	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	7	CHF	33.460	27.076	0,15
CH0009980894	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	3	CHF	12.336	11.604	0,07
CH0009980894	SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR	10	CHF	24.030	18.030	0,10

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Etat du portefeuille-titres (suite) au 30 septembre 2022

(exprimé en CHF)

Numéro ISIN	Dénomination	Quantité / Valeur nominale	Devise	Coût	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
				163.831	158.358	0,90
	Etats-Unis d'Amérique					
US78378X1072	S&P 500 INDICES	1	USD	20.190	21.049	0,12
US78378X1072	S&P 500 INDICES	3	USD	59.608	55.364	0,31
US78378X1072	S&P 500 INDICES	3	USD	27.019	79.577	0,45
US78378X1072	S&P 500 INDICES	2	USD	41.224	42.096	0,24
				148.041	198.086	1,12
	Japon					
JP9010C00002	NIKKEI 225 SGX	(2)	JPY	(999)	(27)	0,00
JP9010C00002	NIKKEI 225 SGX	1	JPY	6.796	12.648	0,07
JP9010C00002	NIKKEI 225 SGX	1	JPY	8.621	3.128	0,02
				14.418	15.749	0,09
Total - Options				326.290	372.193	2,11
Titres et instruments du marché monétaire qui ne sont ni cotés en bourse ni négociés sur un marché réglementé						
Obligations						
	Canada					
US0778FPAF64	Bell 3.65% 21-17.03.51	130.000	USD	133.238	90.516	0,51
				133.238	90.516	0,51
	Etats-Unis d'Amérique					
US031162DD92	Amgen 3.0% 22-22.02.29	200.000	USD	182.870	172.415	0,98
				182.870	172.415	0,98
	Royaume-Uni					
AU3CB0251239	Lloyds Bk 4% 18-07.03.25	500.000	AUD	365.652	304.656	1,73
				365.652	304.656	1,73
	Singapour					
XS2310058891	Dbx Group 1.822% 21-10.03.31	300.000	USD	277.004	260.188	1,47
				277.004	260.188	1,47
Total - Obligations				958.764	827.775	4,69
Total - Titres et instruments du marché monétaire qui ne sont ni cotés en bourse ni négociés sur un marché réglementé				958.764	827.775	4,69
TOTAL DU PORTEFEUILLE-TITRES				19.953.429	16.705.435	94,62

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Répartition géographique et économique du portefeuille-titres au 30 septembre 2022

(en pourcentage de l'actif net)

Répartition géographique	%	Répartition économique	%
Etats-Unis d'Amérique	25,93	Banques et autres institutions financières	19,65
Suisse	18,47	Fonds d'investissements	12,14
Luxembourg	14,16	Pharmacie et cosmétique	9,52
Allemagne	8,04	Holdings et sociétés financières	5,22
Royaume-Uni	6,07	Supranational	4,89
Pays-Bas	3,95	Obligations d'Etats et de villes étrangers	4,67
Japon	2,67	Alimentation, boissons	4,14
Canada	2,57	Transmission de nouvelles	3,85
France	2,05	Santé, éducation et services sociaux	3,75
Norvège	1,86	Internet Software	3,46
Singapour	1,79	Semi-conducteur électronique	3,11
Philippines	1,27	Services divers	2,59
Corée du Sud	1,10	Assurances	2,40
Chili	0,92	Chimie	2,40
Irlande	0,90	Electrotechnique, électronique	2,21
Italie	0,85	Autre	2,02
Suède	0,60	Sociétés immobilières	1,59
Danemark	0,50	Circulation et transport	1,10
Australie	0,46	Mécanique, outillage	1,04
Belgique	0,46	Articles de bureau et ordinateurs	0,98
	94,62	Energie et service des eaux	0,69
		Véhicules routiers	0,65
		Construction, matériel de construction	0,60
		Biotechnologie	0,51
		Sociétés immobilières	0,40
		Mines, aciéries	0,36
		Arts graphiques et maisons d'édition	0,31
		Papier et bois	0,23
		Service d'environnement et de recyclage	0,14
			94,62

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels au 30 septembre 2022

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

Le total de l'actif net du Fonds est exprimé en CHF et correspond à la différence entre le total des actifs et le total des passifs du Fonds. Aux fins de ce calcul, l'actif net de chaque Compartiment est converti en CHF, s'il n'est pas exprimé dans cette devise, aux derniers taux de change connus, qui sont les suivants à la clôture de l'exercice:

1 CHF	=	1,580219	AUD
1 CHF	=	5,495408	BRL
1 CHF	=	1,396037	CAD
1 CHF	=	973,181992	CLP
1 CHF	=	7,243240	CNH
1 CHF	=	7,204666	CNY
1 CHF	=	7,711356	DKK
1 CHF	=	1,037107	EUR
1 CHF	=	0,910151	GBP
1 CHF	=	7,975524	HKD
1 CHF	=	438,77351	HUF
1 CHF	=	15.471,326329	IDR
1 CHF	=	3,613968	ILS
1 CHF	=	82,655548	INR
1 CHF	=	147,061242	JPY
1 CHF	=	1.453,507868	KRW
1 CHF	=	20,429132	MXN
1 CHF	=	1,796167	NZD
1 CHF	=	59,561613	PHP
1 CHF	=	5,018037	PLN
1 CHF	=	11,275130	SEK
1 CHF	=	1,457861	SGD
1 CHF	=	38,323790	THB
1 CHF	=	32,257104	TWD
1 CHF	=	1,016002	USD
1 CHF	=	18,259952	ZAR

Les souscriptions, rachats et conversions sont effectués sur la base d'une valeur nette d'inventaire inconnue.

Principes de valorisation:

- 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.
- Les valeurs mobilières 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

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 2: Principales règles d'évaluation (suite)

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.

- 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 devise autre que celle du compartiment seront converties dans la devise du compartiment au taux moyen du marché correspondant. Les contrats à terme conclus pour couvrir le risque de change sont pris en compte dans la conversion.
- h) Les dividendes sont comptabilisés à la date « ex-dividende » et les taux sont régularisés quotidiennement.
- i) Les bénéfices et pertes réalisés sur la vente de titres sont calculés sur la base du coût moyen d'acquisition.
- j) Calcul de la valeur nette d'inventaire

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

k) Valorisation des opérations de change à terme

Les plus-values et moins-values non réalisées résultant de la valorisation d'opérations de change à terme en cours à la date de clôture des comptes sont comptabilisées dans l'état du patrimoine et le compte de résultat.

l) Plus-values ou moins-values provenant d'opérations sur titres

Les bénéfices et pertes réalisés sur la vente de titres sont calculés sur la base du coût moyen d'acquisition.

m) Partial Swinging Single Prices (PSSP)

La méthode PSSP est retenue pour tous les Compartiments. Dans le cadre de la méthode PSSP, le calcul de la valeur nette d'inventaire tient compte des frais accessoires engagés, via les souscriptions et les rachats, pour l'achat et la vente des investissements (écart entre prix vendeur et prix acheteur, frais de courtage conformes au marché, commissions, prélèvements, etc.). Si, un jour ouvrable bancaire donné, la somme des souscriptions ou des rachats de toutes les classes d'actions d'un Compartiment entraîne un flux entrant ou sortant d'actifs nets dépassant un certain seuil (exprimé en pourcentage de la valeur nette d'inventaire), alors la valeur nette d'inventaire du Compartiment se trouve augmentée ou réduite. Cette somme est appelée « Valeur nette d'inventaire modifiée ». L'ajustement donne lieu à une augmentation de la valeur nette d'inventaire si les mouvements nets entraînent une hausse du nombre d'actions du Compartiment concerné. Il donne lieu à une diminution de la valeur nette d'inventaire si les mouvements nets entraînent une baisse du nombre d'actions.

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 2: Principales règles d'évaluation (suite)

Les frais de transaction occasionnés par les souscriptions et les rachats le jour de la transaction sont à la charge des investisseurs qui passent les ordres relatifs à ces transactions.

La majoration ou la remise appliquée aux frais de transaction occasionnés par les souscriptions ou les rachats est calculée sur une base forfaitaire et se rapporte à une valeur moyenne sur une période antérieure allant jusqu'à un an. L'ajustement maximal s'élève à 2% de la valeur nette d'inventaire du Compartiment.

Si le Fonds est présent sur le marché depuis moins d'un an, ce facteur est déterminé de manière à fournir une valeur représentative en fonction des caractéristiques du Fonds.

Le 30 septembre 2022, des valeurs « Swinging Single Price » ont été comptabilisées dans les Compartiments suivant:

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	en intérêts bancaires et frais à payer
--	--

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

Note 3: Taxe d'abonnement

L'actif du Fonds est soumis au Grand-Duché de Luxembourg à une taxe d'abonnement, payable trimestriellement, de 0,05% p.a. de l'actif net du Fonds pour les classes de parts proposées aux investisseurs privés (A, B, C et M), et de 0,01% p.a. de l'actif net pour les classes de parts proposées aux investisseurs institutionnels (D, G, J et N). Les revenus du Fonds ne sont soumis à aucune imposition au Luxembourg.

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

Note 4: 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. Cette commission est payable 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 30 septembre 2022, les frais d'administration centrale effectifs s'élevaient à:

Compartiment	Classe	FAC (p.a.)	FFG (p.a.)	FFA (p.a.)
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	AT	2,00%	1,55%	0,45%
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	BT	1,23%	0,78%	0,45%
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	DT	0,95%	0,72%	0,23%
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	GT	0,80%	0,57%	0,23%
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	JT	1,05%	0,82%	0,23%
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	MT	0,00%	0,00%	0,00%
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	NT	0,00%	0,00%	0,00%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection	AT	1,10%	0,80%	0,30%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection	BT	0,70%	0,40%	0,30%
Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection	DT	0,55%	0,40%	0,15%

FAC = Frais d'administration centrale / FFG = Frais forfaitaires de gestion / FFA = Frais forfaitaires d'administration

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 4: Commission de gestion (suite)

Outre les frais d'administration centrale, 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.

Note 5: 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). 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 6: «Total Expense Ratio» («TER»)

Le TER indiqué dans la section «Statistiques» du présent rapport a été calculé conformément aux «Directives sur le calcul et la publication du TER et du PTR» publiées par la Swiss Funds and Asset Management Association, SFAMA, le 16 mai 2008. Cette directive a été adaptée à l'ordonnance modifiée sur les organismes de placement collectif (FINMA). La directive TER modifiée est entrée en vigueur le 1er juin 2015. La divulgation du PTR dans le rapport annuel n'est plus obligatoire.

Le TER est calculé pour les 12 derniers mois précédant la date du présent rapport.

Total Expense Ratio (TER) = (frais d'exploitation / actifs nets moyens) x 100

Les frais d'exploitation comprennent toutes les commissions et tous les coûts imputés au fonds. Les frais d'exploitation ne comprennent pas les frais accessoires engagés par le fonds pour l'achat et la vente d'investissements.

Si un fonds investit au moins 10% de ses actifs nets dans d'autres fonds qui publient un TER au sens de la directive émise par la Swiss Funds and Asset Management Association, SFAMA, du 16 mai 2008, un TER composite (synthétique) du fonds de fonds doit être calculé à la date de clôture des comptes annuels ou semestriels. Il s'agit de la somme des TER proportionnels des fonds cibles individuels, pondérés en fonction de leur part des actifs nets du fonds à la date de référence, des commissions d'émission et de rachat effectivement payées des fonds cibles et du TER du fonds de fonds moins les rachats de fonds cibles reçus au cours de la période de référence. Le TER synthétique est calculé à partir des informations disponibles au moment de la rédaction du présent document.

À la fin du premier semestre de l'exercice, il n'a pas été nécessaire de déclarer le TER synthétique, les conditions susmentionnées n'étant pas remplies.

Note 7: Explications sur les contrats de change à terme

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

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en USD)
BRL	8.953.877	USD	1.663.761	03.10.2022	(8.260)
					(8.260)

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 7: Explications sur les contrats de change à terme (suite)

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Devise	Achats	Devise	Ventes	Echéance	Résultat non réalisé (en CHF)
CHF	199.122	AUD	300.000	06.12.2022	10.432
CHF	221.989	CAD	300.000	06.12.2022	8.534
CHF	282.083	CNH	2.000.000	06.12.2022	7.256
CHF	1.664.149	EUR	1.700.000	06.12.2022	27.977
CHF	563.508	GBP	500.000	06.12.2022	17.392
CHF	839.245	JPY	120.000.000	06.12.2022	22.824
CHF	5.108.696	USD	5.250.000	06.12.2022	(25.465)
					68.950

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

Note 8: Engagements conditionnels liés aux options

Au moment de l'établissement du rapport, le compartiment Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection présentait les engagements conditionnels liés aux options suivantes:

NIKKEI 225 SGX

Devise:	JPY
Put/Call:	CALL
Strike:	29.875
Echéance:	14.10.2022
Nombre de contrats:	(2)
Engagement:	(260.100)
Valeur du marché:	(27)

NIKKEI 225 SGX

Devise:	JPY
Put/Call:	PUT
Strike:	23.750
Echéance:	09.12.2022
Nombre de contrats:	1
Engagement:	(5.774.220)
Valeur du marché:	3.128

DJ EURO STOXX 50

Devise:	EUR
Put/Call:	PUT
Strike:	3.450
Echéance:	16.12.2022
Nombre de contrats:	8
Engagement:	(161.064)
Valeur du marché:	17.803

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 8: Engagements conditionnels liés aux options (suite)

S&P 500 INDICES

Devise:	USD
Put/Call:	PUT
Strike:	3.650
Echéance:	16.12.2022
Nombre de contrats:	3
Engagement:	(555.054)
Valeur du marché:	55.364

S&P 500 INDICES

Devise:	USD
Put/Call:	PUT
Strike:	3.800
Echéance:	16.12.2022
Nombre de contrats:	3
Engagement:	(712.104)
Valeur du marché:	79.577

SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR

Devise:	CHF
Put/Call:	PUT
Strike:	10.400
Echéance:	16.12.2022
Nombre de contrats:	10
Engagement:	(554.448)
Valeur du marché:	43.440

SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR

Devise:	CHF
Put/Call:	PUT
Strike:	9.650
Echéance:	16.12.2022
Nombre de contrats:	10
Engagement:	(267.983)
Valeur du marché:	18.030

DJ EURO STOXX 50

Devise:	EUR
Put/Call:	PUT
Strike:	3.275
Echéance:	17.03.2023
Nombre de contrats:	8
Engagement:	(113.585)
Valeur du marché:	16.415

S&P 500 INDICES

Devise:	USD
Put/Call:	PUT
Strike:	3.525
Echéance:	17.03.2023
Nombre de contrats:	3
Engagement:	(428.123)
Valeur du marché:	63.145

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 8: Engagements conditionnels liés aux options (suite)

SMI INDEX/OHNE DIVIDENDENKOR

Devise:	CHF
Put/Call:	PUT
Strike:	9.800
Echéance:	17.03.2023
Nombre de contrats:	10
Engagement:	(369.632)
Valeur du marché:	38.680

NIKKEI 225 SGX

Devise:	JPY
Put/Call:	PUT
Strike:	25.500
Echéance:	09.06.2023
Nombre de contrats:	1
Engagement:	(11.496.420)
Valeur du marché:	12.648

DJ EURO STOXX 50

Devise:	EUR
Put/Call:	PUT
Strike:	3.350
Echéance:	16.06.2023
Nombre de contrats:	8
Engagement:	(129.061)
Valeur du marché:	23.990

Les options ont été conclues avec la contrepartie suivante: J.P.Morgan Securities PLC.

Note 9: Modifications du portefeuille-titres

Les informations sur les modifications du portefeuille-titres relatives à la période sous revue sont à la disposition de tous les porteurs de parts sur le site Internet de Swisscanto (www.swisscanto.com) ou peuvent être demandées gratuitement directement auprès de Swisscanto Asset Management AG, au siège de la société de gestion, du dépositaire et du représentant en Suisse, auprès de l'agent payeur et d'information allemand ainsi qu'auprès de tous les bureaux des banques cantonales et de tous les agents payeurs et distributeurs.

Note 10: 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 11: Investissements transversaux des compartiments

Le rapport semi-annuel consolidé n'a pas été corrigé de l'investissement suivant, commun au compartiment Swisscanto (LU) Umbrella Fund Systematic Responsible:

Fonds cible	Devise	Valeur d'évaluation	% de l'actif net
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	CHF	663.461	2,84
Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit	CHF	2.011.586	9,30

Swisscanto (LU)

Notes aux Etats Financiers semestriels (suite) au 30 septembre 2022

Note 12: Conflit russe

En février 2022, plusieurs pays (dont les États-Unis, le Royaume-Uni et l'UE) ont imposé des sanctions à certaines institutions et personnes en Russie en raison de la reconnaissance officielle des Républiques populaires de Donetsk et de Lougansk par la Fédération de Russie. Après les opérations militaires contre l'Ukraine lancées par la Russie le 24 février 2022, d'autres sanctions éventuelles ont été annoncées.

Compte tenu des tensions géopolitiques croissantes, la volatilité des marchés des valeurs mobilières et des changes a considérablement augmenté depuis février 2022 et le rouble s'est déprécié par rapport au dollar américain et à l'euro. Ces événements pourraient affecter les activités des entreprises russes dans différents secteurs économiques.

La Société considère ces événements comme des événements postérieurs à la période sous revue qui ne doivent pas être pris en considération. Bien qu'au moment du présent rapport, ni les performances de la Société, ni la continuité d'exploitation, ni les activités de la Société n'aient été touchées par les événements mentionnés ci-dessus, le Conseil d'administration continue de surveiller l'évolution de la situation et son incidence sur la situation financière et les résultats de la Société.

Note 13: L'épidémie de coronavirus

L'épidémie de coronavirus bouleverse les perspectives de Swisscanto Asset Management International S.A. pour la période 2022 en cours et, par conséquent, celles du Swisscanto (LU) 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) 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)

Informations complémentaires

Règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres (règlement de l'UE 2015/2365)

Au cours de la période concernée par le présent rapport, la Société n'a pas réalisé des transactions soumises au règlement de l'Union européenne 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation. Par conséquent, le rapport ne contient aucune information globale, sur la concentration ou les transactions, ou encore sur la réutilisation ou la conservation des titres.