

Swisscanto (LU)

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30.09.2023

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

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

Depotbank: CACEIS Investor Services Bank S.A.

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

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

Inhaltsverzeichnis

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

1 Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat

Präsident

Hans Frey, Schweiz, Geschäftsführer Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Mitglieder

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

Geschäftsführung

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

Depotbank, Hauptzahl-, Zentralverwaltungs-, Register- und Transferstelle

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

Portfolio Manager

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

Zahl- und Vertriebsstellen

Deutschland

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

Liechtenstein

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

Luxemburg

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

Österreich

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

Zahlstelle in der Schweiz

Basler Kantonalbank
Spiegelgasse 2, CH-4002 Basel

Vertreterstelle in der Schweiz

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

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

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

2 Allgemeine Informationen

Anlagefonds nach luxemburgischem Recht „Umbrella Construction“

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

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

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

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

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

Verkaufsbeschränkungen

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

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

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

Risikomanagementverfahren

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

3 Aktivitätsbericht

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Klasse	ISIN	Valor	Distribution
AT	LU0338548034	003650277	Thesaurierend
BT	LU0999461055	23115375	Thesaurierend
DT	LU0338548117	3650280	Thesaurierend
GT	LU0866273294	20252840	Thesaurierend
MT	LU2099034824	51747447	Thesaurierend
NT	LU0866272569	20252839	Thesaurierend
ST (Lancierung 18.04.2023)	LU2604819834	126041189	Thesaurierend

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Klasse	ISIN	Valor	Distribution
AT	LU0562145853	12041875	Thesaurierend
BT	LU0999461139	23115403	Thesaurierend
DT	LU0562149921	12041876	Thesaurierend

4 Vermögensaufstellung

	Erläuterung	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection CHF	Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets USD	Konsolidiert CHF
VERMÖGENSWERTE				
Wertpapierbestand inklusive Optionen (gekauft Optionen) zum Marktwert	(2,8)	14'920'882	511'113'103	482'487'148
Bankguthaben		475'937	18'562'167	17'456'608
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		194'800	3'166'651	3'091'653
Forderung aus Devisenkäufen		13'563	8'387'189	7'686'163
Ausstehende Zeichnungsbeträge		0	117'998	107'944
Forderungen aus Swaps und Swaptions		0	0	0
Forderungen aus Wertpapiererträgen		58'155	1'178'943	1'136'652
Zinsforderungen aus Bankguthaben		909	58'546	54'467
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften	(6)	9'173'150	0	9'173'150
Nicht realisierter Gewinn aus Termingeschäften		0	0	0
Nicht realisierter Gewinn aus Swapgeschäften	(9)	905'377	0	905'377
Sonstige Vermögenswerte		0	0	0
SUMME DER VERMÖGENSWERTE		25'742'772	542'584'597	522'099'162
VERBINDLICHKEITEN				
Optionen (geschriebene Optionen) zum Marktwert		0	0	0
Bankverbindlichkeiten		0	0	0
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		-194'841	-7'660'071	-7'202'274
Verbindlichkeiten aus Devisenkäufen		-13'533	-8'397'678	-7'695'728
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Anteilen		-31'934	-13'688	-44'456
Verbindlichkeiten aus Swaps und Swaptions		0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften	(6)	-9'429'921	0	-9'429'921
Nicht realisierter Verlust aus Termingeschäften		0	0	0
Nicht realisierter Verlust aus Swapgeschäften	(9)	-914'800	0	-914'800
Bankzinsen und sonstige Verbindlichkeiten		-14'817	-328'871	-315'668
SUMME DER VERBINDLICHKEITEN		-10'599'846	-16'400'308	-25'602'848
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES		15'142'926	526'184'289	496'496'314

Entwicklung der Anzahl Anteile

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Klasse	Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Bestand am Ende der Rechnungsperiode
AT	139'858.609	10'587.902	-9'698.022	140'748.489
BT	4'231.986	0.000	-514.000	3'717.986
DT	295'483.753	38'275.812	-128'392.403	205'367.162
GT	508'524.536	37'131.682	-42'967.534	502'688.684
MT	6'040.000	0.000	0.000	6'040.000
NT	2'894'864.774	168'041.831	-88'577.666	2'974'328.939
ST	0.000	575.000	0.000	575.000

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Klasse	Bestand zu Beginn der Rechnungsperiode	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Bestand am Ende der Rechnungsperiode
AT	174'017.245	477.340	-14'938.930	159'555.655
BT	1'005.787	6.146	-43.389	968.544
DT	4'650.000	0.000	0.000	4'650.000

5 Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens

Erläuterung	Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection CHF	Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets USD	Konsolidiert CHF
NETTOVERMÖGEN ZU BEGINN DES GESCHÄFTSJAHRES	17'151'152	481'258'686	489'265'923
ERTRÄGE			
Dividenden aus Wertpapierbestand, netto	60'159	8'972'915	8'268'581
Nettozinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	94'817	0	94'817
Zinserträge aus Bankguthaben	6'708	341'915	319'492
Zinsen aus Swaps, netto	19'166	0	19'166
Erhaltene Kommissionen (13)	0	0	0
Sonstige Erträge	0	0	0
GESAMTERTRÄGE	180'849	9'314'829	8'702'055
AUFWENDUNGEN			
Transaktionskosten	0	0	0
Pauschale Verwaltungskommission (3)	-86'538	-636'966	-669'235
Abonnementsteuer ("taxe d'abonnement") (4)	-3'405	-30'857	-31'633
Zinsaufwendungen aus Bankverbindlichkeiten	-53	-1'550	-1'471
Zinsaufwendungen aus Swaps, netto	-23'976	0	-23'976
Sonstige Aufwendungen	-5'498	-18'832	-22'725
GESAMTAUFWENDUNGEN	-119'470	-688'205	-749'040
ERTRAGSAUSGLEICH	-2'469	-23'004	-23'513
SUMME DER NETTOERTRÄGE	58'910	8'603'620	7'929'502
Nettorealisierte Wertpapiererhöhungen/ (Wertverminderungen) aus Wertpapieren	-286'901	2'147'420	1'677'558
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Swaps	0	0	0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Optionen	-104'318	0	-104'318
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisentermingeschäften	462'709	-8'995	454'480
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Termingeschäften	0	0	0
Nettorealisierte Werterhöhungen/(Wertverminderungen) aus Devisengeschäften	-9'704	-382'887	-359'969
NETTOGEWINN (-VERLUST) AUS ANLAGEN	120'695	10'359'158	9'597'253
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REAL. ERFOLGES			
- aus Wertpapieren	-507'973	-17'397'339	-7'082'578
- aus Swaps	0	0	0
- aus Termingeschäften	0	0	0
- aus Devisentermingeschäften	-256'772	0	-256'772
- aus Optionen	0	0	0
NETTOERHÖHUNG/NETTOVERMINDERUNG DES NETTOVERMÖGENS	-644'049	-7'038'182	-7'082'578
Zeichnung von Anteilen (2)	45'712	90'288'290	82'641'439
Rücknahme von Anteilen (2)	-1'412'358	-38'347'509	-36'492'659
Ausschüttungen	0	0	0
Ertragsausgleich	2'469	23'004	23'513
Bewertungsdifferenz (2)			-31'859'325
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	13'411'527	528'225'421	496'632'142

6 Statistik

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

	Klasse	30.09.2023	31.03.2023	31.03.2022
Nettovermögen		526'184'289.21	482'291'447	398'491'884
Nettovermögenswert pro Anteil	AT	136.50	139.87	153.96
Nettovermögenswert pro Anteil	BT	117.34	119.76	130.81
Nettovermögenswert pro Anteil	DT	154.17	157.12	171.07
Nettovermögenswert pro Anteil	GT	123.29	125.56	136.50
Nettovermögenswert pro Anteil	MT	99.79	101.24	109.23
Nettovermögenswert pro Anteil	NT	119.65	121.36	130.89
Nettovermögenswert pro Anteil	ST	98'106.55	-	-
TER pro Anteil	AT	2.05		
TER pro Anteil	BT	1.28		
TER pro Anteil	DT	0.96		
TER pro Anteil	GT	0.81		
TER pro Anteil	MT	0.05		
TER pro Anteil	NT	0.01		
TER pro Anteil	ST	0.01		

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

	Klasse	30.09.2023	31.03.2023	31.03.2022
Nettovermögen		15'142'926.08	17'164'091	21'221'635
Nettovermögenswert pro Anteil	AT	91.48	95.35	105.86
Nettovermögenswert pro Anteil	BT	95.12	98.95	109.42
Nettovermögenswert pro Anteil	DT	97.75	101.59	112.13
TER pro Anteil	AT	1.15		
TER pro Anteil	BT	0.74		
TER pro Anteil	DT	0.56		

7 Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Wertpapierbestand zum 30.09.2023 (Angaben in USD)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						
Aktien						
AE						
AEA000201011	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2'400'776	AED	5'708'248	5'653'806	1.11
				5'708'248	5'653'806	1.11
BR						
BRYDUQACNOR3	YDUQS PARTICIPACOES SA	897'800	BRL	3'868'375	3'564'151	0.70
BRWEGEACNOR0	WEG SA	881'200	BRL	6'054'636	6'385'584	1.25
BRSBSPACNOR5	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	415'956	BRL	4'462'895	5'071'884	0.99
BRRADLACNOR0	RAIA DROGASIL SA	1'066'300	BRL	5'899'435	5'884'122	1.15
BRHYPEACNOR0	HYPERA SA	1'079'900	BRL	8'639'040	8'013'164	1.57
BRCMIGACNPR3	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3'018'029	BRL	6'751'175	7'482'966	1.46
BRBBASACNOR3	BANCO DO BRASIL S.A.	903'600	BRL	6'867'216	8'517'512	1.67
				42'542'772	44'919'382	8.79
CN						
KYG9830F1063	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	3'722'000	HKD	8'006'015	6'909'974	1.35
KYG970081173	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	308'500	HKD	3'475'406	1'798'173	0.35
KYG875721634	TENCENT HOLDINGS LTD	538'423	HKD	24'997'557	21'050'597	4.12
KYG8208B1014	JD.COM INC-CLASS A	192'194	HKD	5'603'574	2'824'560	0.55
KYG6427A1022	NETEASE INC	206'600	HKD	4'582'070	4'207'524	0.82
KYG596691041	MEITUAN-CLASS B	408'052	HKD	10'223'758	5'970'844	1.17
KYG4232C1087	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	680'563	HKD	1'786'841	1'442'487	0.28
KYG070341048	BAIDU INC-CLASS A	403'788	HKD	7'121'070	6'877'726	1.35
KYG017191142	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2'074'751	HKD	30'669'271	22'676'466	4.45
HK0992009065	LENOVO GROUP LTD	8'202'000	HKD	8'073'267	8'451'405	1.65
CNE1000048K8	HAIER SMART HOME CO LTD-H	3'272'400	HKD	11'123'853	10'299'566	2.02
CNE100003662	CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	169'620	CNY	6'823'538	4'726'754	0.92
CNE100001FR6	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1'251'892	CNY	6'245'565	4'687'453	0.92
CNE100000FN7	SINOPHARM GROUP CO-H	3'159'600	HKD	8'720'976	9'157'851	1.79
CNE1000003X6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1'723'371	HKD	12'548'450	9'869'084	1.93
CNE1000002H1	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	19'878'000	HKD	12'652'295	11'218'391	2.19
CNE000001G38	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3'067'525	CNY	8'197'140	9'342'673	1.83
				170'850'645	141'511'532	27.69
ID						
ID1000129000	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	44'863'260	IDR	11'268'623	10'884'948	2.13
ID1000118201	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	21'369'625	IDR	5'959'451	7'224'162	1.41
ID1000095003	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	18'329'200	IDR	5'343'469	7'145'043	1.40
				22'571'543	25'254'153	4.94
IN						
INE752E01010	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	3'658'581	INR	7'967'292	8'800'466	1.72
INE238A01034	AXIS BANK LTD	674'991	INR	8'000'941	8'426'695	1.65
INE196A01026	MARICO LTD	968'214	INR	6'355'033	6'548'522	1.28
INE176B01034	HAVELLS INDIA LTD	387'840	INR	6'364'774	6'487'023	1.27

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
INE040A01034	HDFC BANK LIMITED	511'536	INR	10'419'784	9'402'045	1.84
INE030A01027	HINDUSTAN UNILEVER LTD	415'157	INR	12'929'097	12'326'540	2.41
INE009A01021	INFOSYS LTD	582'102	INR	10'193'156	10'062'210	1.97
				62'230'077	62'053'500	12.14
JO						
GB00B0LCW083	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	261'492	GBP	6'725'702	6'664'146	1.30
				6'725'702	6'664'146	1.30
KR						
KR7105560007	KB FINANCIAL GROUP INC	276'249	KRW	10'733'700	11'321'008	2.21
KR7051910008	LG CHEM LTD	7'769	KRW	4'090'846	2'858'536	0.56
KR7021240007	COWAY CO LTD	138'543	KRW	6'194'011	4'240'274	0.83
KR7012330007	HYUNDAI MOBIS CO LTD	36'503	KRW	6'663'407	6'505'832	1.27
KR7006400006	SAMSUNG SDI CO LTD	8'204	KRW	3'878'923	3'112'826	0.61
KR7005931001	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	321'596	KRW	13'094'116	12'988'721	2.54
KR7005930003	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	330'831	KRW	16'588'899	16'769'555	3.28
KR7005830005	DB INSURANCE CO LTD	118'012	KRW	6'204'301	7'818'491	1.53
KR7000660001	SK HYNIX INC	74'219	KRW	6'670'909	6'308'669	1.23
				74'119'112	71'923'910	14.06
MX						
MXP370711014	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1'177'600	MXN	7'382'232	9'900'690	1.94
				7'382'232	9'900'690	1.94
PE						
BMG2519Y1084	CREDICORP LTD	64'200	USD	8'424'532	8'215'674	1.61
				8'424'532	8'215'674	1.61
PL						
PLPZU0000011	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	524'153	PLN	3'775'503	4'967'689	0.97
				3'775'503	4'967'689	0.97
SA						
SA0007879543	SAUDI TELECOM CO	1'095'454	SAR	11'158'595	10'982'434	2.15
				11'158'595	10'982'434	2.15
TH						
KYG3323L1005	FABRINET	42'132	USD	3'840'860	7'020'034	1.37
				3'840'860	7'020'034	1.37
TW						
TW0009921007	GIANT MANUFACTURING	397'319	TWD	2'902'046	2'197'036	0.43
TW0006409006	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	116'000	TWD	6'402'009	5'695'698	1.11
TW0002891009	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	12'201'067	TWD	8'986'135	9'260'269	1.81
TW0002383007	ELITE MATERIAL CO LTD	631'189	TWD	3'390'563	8'368'794	1.64
TW0002377009	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	1'325'000	TWD	6'363'161	6'731'617	1.32
TW0002345006	ACCTON TECHNOLOGY CORP	475'000	TWD	4'758'554	7'254'379	1.42
TW0002330008	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2'468'000	TWD	40'244'937	39'985'868	7.83
TW0002308004	DELTA ELECTRONICS INC	929'000	TWD	7'422'782	9'338'779	1.83
				80'470'186	88'832'439	17.39
US						
KYG114741062	BIZLINK HOLDING INC	827'682	TWD	7'323'446	6'922'882	1.35
				7'323'446	6'922'882	1.35

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
ZA						
ZAE000134854	CLICKS GROUP LTD	478'536	ZAR	6'910'110	6'569'920	1.29
GB00B1CRLC47	MONDI PLC	580'282	GBP	11'332'865	9'720'912	1.90
				18'242'975	16'290'832	3.19
Summe - Aktien					511'113'103	
Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					511'113'103	
An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						
Aktien						
HK						
KYG211311009	CHINA METAL RECYCLING	1'053'000	HKD	1'102'880	0	0.00
				1'102'880	0	0.00
Summe - Aktien					0	
Summe - An einem anderen geregelten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					0	
SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES					511'113'103	100.00

8 Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Wertpapierbestand zum 30.09.2023 (Angaben in USD)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						
Aktien						
AU						
AU000000SUN6	SUNCORP GROUP LTD	8'194	AUD	61'902	67'585	0.46
				61'902	67'585	0.46
CA						
CA7751092007	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	1'055	CAD	48'132	37'227	0.25
CA6330671034	NATIONAL BANK OF CANADA	960	CAD	69'073	58'610	0.40
				117'205	95'837	0.65
CH						
CH1176493729	BACHEM HOLDING AG	589	CHF	44'362	40'052	0.27
CH1175448666	STRAUMANN HOLDING AG-REG	222	CHF	27'980	26'018	0.18
CH1169151003	FISCHER (GEORG)-REG	191	CHF	12'443	9'865	0.07
CH1101098163	BELIMO HOLDING AG-REG	59	CHF	24'365	25'712	0.18
CH0435377954	SIG GROUP AG	4'187	CHF	97'143	94'794	0.65
CH0432492467	ALCON INC	1'722	CHF	123'305	122'159	0.83
CH0418792922	SIKA AG-REG	523	CHF	145'930	121'911	0.83
CH0406705126	SENSIRION HOLDING AG	165	CHF	16'812	12'111	0.08
CH0360674466	GALENICA AG	167	CHF	11'872	11'314	0.08
CH0311864901	VAT GROUP AG	171	CHF	52'889	56'259	0.38
CH0276534614	ZEHNDER GROUP AG-REG	188	CHF	17'721	10'114	0.07
CH0244767585	UBS GROUP AG-REG	2'094	CHF	45'617	47'513	0.32
CH0126673539	DKSH HOLDING AG	443	CHF	34'917	27'488	0.19
CH0102484968	JULIUS BAER GROUP LTD	509	CHF	29'926	29'960	0.20
CH0038863350	NESTLE SA-REG	3'760	CHF	432'248	390'062	2.66
CH0024608827	PARTNERS GROUP HOLDING AG	56	CHF	57'585	57'932	0.40
CH0022427626	LEM HOLDING SA-REG	15	CHF	28'853	30'675	0.21
CH0014852781	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	134	CHF	69'764	76'594	0.52
CH0014284498	SIEGFRIED HOLDING AG-REG	99	CHF	69'242	77'666	0.53
CH0013841017	LONZA GROUP AG-REG	246	CHF	139'471	104'698	0.71
CH0013396012	SKAN GROUP AG	296	CHF	23'841	23'029	0.16
CH0012549785	SONOVA HOLDING AG-REG	106	CHF	28'623	23'076	0.16
CH0012221716	ABB LTD-REG	2'705	CHF	84'679	88'724	0.61
CH0012214059	HOLCIM LTD	441	CHF	21'606	25'922	0.18
CH0012100191	TECAN GROUP AG-REG	253	CHF	87'645	78'228	0.53
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1'070	CHF	350'652	267'982	1.83
CH0012005267	NOVARTIS AG-REG	2'389	CHF	190'300	224'255	1.53
CH0011075394	ZURICH INSURANCE GROUP AG	361	CHF	145'130	151'656	1.03
CH0010645932	GIVAUDAN-REG	4	CHF	14'283	11'976	0.08
CH0006372897	INTERROLL HOLDING AG-REG	7	CHF	20'425	17'570	0.12
				2'449'629	2'285'315	15.59
DE						
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY AG	807	EUR	13'364	9'676	0.07
DE000ENAG999	E.ON SE	1'902	EUR	20'435	20'632	0.14

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
DE0008404005	ALLIANZ SE-REG	311	EUR	59'431	67'985	0.46
DE0007236101	SIEMENS AG-REG	567	EUR	79'402	74'500	0.51
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG	1'267	EUR	43'698	38'477	0.26
DE0005664809	EVOTEC SE	795	EUR	31'693	14'553	0.10
				248'023	225'823	1.54
	DK					
DK0062498333	NOVO NORDISK A/S-B	965	DKK	58'823	80'705	0.55
DK0061539921	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1'107	DKK	28'771	21'792	0.15
				87'594	102'497	0.70
	FR					
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SE	355	EUR	52'453	53'975	0.37
FR0000120644	DANONE	956	EUR	52'133	48'389	0.33
				104'586	102'364	0.70
	GB					
GB00BM8PJY71	NATWEST GROUP PLC	12'191	GBP	35'064	32'083	0.22
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	68	GBP	3'371	3'084	0.02
GB00B10RZP78	UNILEVER PLC	1'763	EUR	82'594	79'960	0.55
GB0009895292	ASTRAZENECA PLC	523	GBP	61'917	64'831	0.44
				182'946	179'959	1.23
	IE					
IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC-CL A	199	USD	59'166	55'908	0.38
				59'166	55'908	0.38
	IL					
US83417M1045	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	189	USD	48'707	22'392	0.15
				48'707	22'392	0.15
	IT					
IT0004176001	PRYSMIAN SPA	878	EUR	31'648	32'442	0.22
				31'648	32'442	0.22
	JP					
JP3942400007	ASTELLAS PHARMA INC	3'800	JPY	58'082	48'314	0.33
JP3910660004	TOKIO MARINE HOLDINGS INC	1'700	JPY	30'712	36'111	0.25
JP3890350006	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR	1'100	JPY	41'002	49'544	0.34
JP3571400005	TOKYO ELECTRON LTD	400	JPY	56'825	50'122	0.34
JP3435000009	SONY GROUP CORP	900	JPY	92'404	67'532	0.46
JP3358000002	SHIMANO INC	200	JPY	51'154	24'724	0.17
				330'179	276'346	1.89
	LU					
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC	244	EUR	27'209	12'643	0.09
				27'209	12'643	0.09
	NL					
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	1'504	EUR	44'813	41'545	0.28
NL0010273215	ASML HOLDING NV	102	EUR	67'863	55'234	0.38
				112'676	96'779	0.66
	SE					
US0528001094	AUTOLIV INC	416	USD	35'075	36'716	0.25
SE0020050417	BOLIDEN AB	1'523	SEK	59'007	40'326	0.28
SE0015988019	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4'811	SEK	48'557	29'086	0.20

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
				142'639	106'128	0.73
	SG					
SG1S04926220	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	7'100	SGD	57'553	60'958	0.42
				57'553	60'958	0.42
	US					
US94106L1098	WASTE MANAGEMENT INC	166	USD	24'877	23'149	0.16
US92826C8394	VISA INC-CLASS A SHARES	322	USD	66'201	67'753	0.46
US92532F1003	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	290	USD	74'504	92'253	0.63
US91324P1021	UNITEDHEALTH GROUP INC	209	USD	83'237	96'398	0.66
US9113631090	UNITED RENTALS INC	94	USD	30'098	38'229	0.26
US8923561067	TRACTOR SUPPLY COMPANY	320	USD	60'065	59'440	0.41
US8835561023	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	182	USD	95'269	84'274	0.58
US88160R1014	TESLA INC	240	USD	63'724	54'936	0.37
US8725901040	T-MOBILE US INC	392	USD	52'822	50'222	0.34
US8716071076	SYNOPSIS INC	150	USD	58'653	62'980	0.43
US78409V1044	S&P GLOBAL INC	171	USD	66'314	57'161	0.39
US6907421019	OWENS CORNING	620	USD	51'582	77'368	0.53
US6821891057	ON SEMICONDUCTOR	262	USD	17'359	22'278	0.15
US67066G1040	NVIDIA CORP	225	USD	57'172	89'534	0.61
US5951121038	MICRON TECHNOLOGY INC	796	USD	49'232	49'538	0.34
US5949181045	MICROSOFT CORP	832	USD	219'015	240'322	1.64
US5763231090	MASTEC INC	184	USD	12'402	12'114	0.08
US5717481023	MARSH & MCLENNAN COS	392	USD	58'041	68'242	0.47
US5486611073	LOWE'S COS INC	361	USD	69'938	68'638	0.47
US5324571083	ELI LILLY & CO	231	USD	78'003	113'506	0.77
US4943681035	KIMBERLY-CLARK CORP	569	USD	73'018	62'905	0.43
US49338L1035	KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	269	USD	41'118	32'559	0.22
US3755581036	GILEAD SCIENCES INC	615	USD	41'668	42'161	0.29
US34959E1091	FORTINET INC	430	USD	22'472	23'083	0.16
US3364331070	FIRST SOLAR INC	376	USD	44'517	55'581	0.38
US29261A1007	ENCOMPASS HEALTH CORP	390	USD	21'287	23'961	0.16
US2441991054	DEERE & CO	104	USD	33'332	35'904	0.24
US15135B1017	CENTENE CORP	359	USD	22'396	22'621	0.15
US14448C1045	CARRIER GLOBAL CORP	1'120	USD	43'160	56'557	0.39
US09857L1089	BOOKING HOLDINGS INC	11	USD	30'332	31'033	0.21
US09062X1037	BIOGEN INC	96	USD	25'208	22'571	0.15
US0476491081	ATKORE INC	427	USD	42'470	58'277	0.40
US0382221051	APPLIED MATERIALS INC	418	USD	49'591	52'941	0.36
US0378331005	APPLE INC	936	USD	132'625	146'599	1.00
US0304201033	AMERICAN WATER WORKS CO INC	422	USD	62'095	47'804	0.33
US02079K3059	ALPHABET INC-CL A	1'882	USD	225'815	225'296	1.54
US0126531013	ALBEMARLE CORP	202	USD	40'564	31'422	0.21
US00724F1012	ADOBE INC	141	USD	54'783	65'770	0.45
US0010551028	AFLAC INC	1'095	USD	58'334	76'881	0.52
IE00B8KQN827	EATON CORP PLC	323	USD	50'325	63'020	0.43
IE00059YS762	LINDE PLC	241	USD	72'711	82'091	0.56
				2'476'329	2'687'371	18.33
	Summe - Aktien				6'410'347	
	Anleihen					

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
AU						
XS2342206591	WSTP 0.766 05/13/31	100'000	EUR	102'875	85'766	0.59
AU35G0002579	TCV 2 09/17/35	200'000	AUD	92'399	83'748	0.57
				195'275	169'513	1.16
CA						
CA135087D358	CAN 2 3/4 12/01/48	150'000	CAD	128'919	83'529	0.57
				128'919	83'529	0.57
CL						
XS2369244087	CHILE 0.1 01/26/27	200'000	EUR	187'512	169'561	1.16
				187'512	169'561	1.16
DE						
US515110BP87	RENTEN 2 3/8 06/10/25	450'000	USD	452'124	392'254	2.68
US500769GQ12	KFW 2 05/02/25	300'000	USD	291'674	260'743	1.78
US500769CG75	KFW 2.6 06/20/37	50'000'000	JPY	511'860	373'727	2.55
DE0001102432	DBR 1 1/4 08/15/48	99'405	EUR	151'813	67'297	0.46
				1'407'471	1'094'021	7.47
DK						
DK0009923807	DGB 0 1/2 11/15/29	1'000'000	DKK	118'306	112'346	0.77
				118'306	112'346	0.77
FR						
FR001400F6X7	SOGRPR 3 1/2 05/25/43 EMTN	200'000	EUR	188'641	175'043	1.19
				188'641	175'043	1.19
GB						
XS2333299324	IFFIM 1 04/21/26 GMTN	100'000	USD	90'294	82'462	0.56
XS0222383027	GSK 4 06/16/25 EMTN	200'000	EUR	251'508	195'811	1.34
US046353AX64	AZN 2 1/8 08/06/50	100'000	USD	57'341	50'144	0.34
AU3CB0251239	LLOYDS 4 03/07/25 MTN	100'000	AUD	73'130	57'689	0.39
				472'274	386'105	2.63
JP						
XS0241265445	EJRAIL 4 1/2 01/25/36	200'000	GBP	333'505	201'021	1.37
				333'505	201'021	1.37
NL						
XS2428716000	DLR 1 3/8 07/18/32	100'000	EUR	78'579	71'143	0.49
XS2199719233	BNG 0 1/8 07/09/35	250'000	EUR	262'802	162'982	1.11
				341'380	234'125	1.60
NO						
XS2432567555	DNBNO 0 3/8 01/18/28 EMTN	200'000	EUR	203'608	171'837	1.17
XS2189767515	KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	204'000	USD	184'125	146'683	1.00
				387'733	318'520	2.17
NZ						
XS2343772724	ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	100'000	EUR	84'129	73'314	0.50
				84'129	73'314	0.50
SG						
XS2310058891	DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	300'000	USD	277'004	248'486	1.70
				277'004	248'486	1.70
US						

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
XS2439004685	PLD 1 1/2 02/08/34	100'000	EUR	76'184	70'779	0.48
XS2348234936	BAC 1.667 06/02/29 EMTN	120'000	GBP	152'953	111'007	0.76
XS0291949120	T 5 1/2 03/15/27	150'000	GBP	230'172	164'694	1.12
US94973VBF31	ELV 5.1 01/15/44	400'000	USD	487'157	319'924	2.18
US92826CAL63	V 1.9 04/15/27	350'000	USD	343'666	287'221	1.96
US92343V GK44	VZ 3.4 03/22/41	450'000	USD	430'015	289'912	1.98
US883556CL42	TMO 2 10/15/31	100'000	USD	76'901	71'077	0.49
US713448EP96	PEP 2 7/8 10/15/49	200'000	USD	136'920	119'753	0.82
US594918BR43	MSFT 2.4 08/08/26	150'000	USD	151'737	127'516	0.87
US594918BD56	MSFT 3 3/4 02/12/45	450'000	USD	371'913	329'167	2.25
US532457BY33	LLY 2 1/4 05/15/50	100'000	USD	60'755	51'781	0.35
US172967MD09	C 4.65 07/23/48	100'000	USD	101'281	73'886	0.50
US09247X AQ43	BLK 2.4 04/30/30	200'000	USD	157'100	152'413	1.04
US075887CL11	BDX 1.957 02/11/31	75'000	USD	68'001	53'687	0.37
US04636NAE31	AZN 1 3/4 05/28/28	200'000	USD	162'383	156'526	1.07
US02079KAG22	GOOGL 2 1/4 08/15/60	320'000	USD	207'806	155'478	1.06
US02079KAF49	GOOGL 2.05 08/15/50	200'000	USD	112'669	100'163	0.68
US001055AY85	AFL 4 3/4 01/15/49	100'000	USD	88'757	76'565	0.52
				3'416'369	2'711'548	18.50
	XS					
XS2332164966	EIB 2.7 04/22/24 EMTN	1'000'000	CNY	143'876	124'954	0.85
XS2288938546	EBRD 2 01/21/25 GMTN	1'000'000	CNY	140'889	124'063	0.85
XS1958237403	ASIA 2.9 03/05/24 GMTN	1'000'000	CNY	136'132	125'183	0.85
XS1280834992	EIB 0 1/2 11/15/23 EMTN	50'000	EUR	57'345	48'258	0.33
XS0307424274	ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	30'000'000	JPY	288'137	198'294	1.35
XS0282506657	EIB 2.15 01/18/27	20'000'000	JPY	189'193	130'555	0.89
EU000A3K4DD8	EU 1 07/06/32 NGEU	100'000	EUR	85'731	79'122	0.54
				1'041'304	830'430	5.66
	Summe - Anleihen				6'807'563	
	Optionen					
	CH					
DE000C7H5296	SMI 12/15/23 P10250	60	CHF	18'996	3'762	0.03
DE000C6Y5YX7	SMI 06/21/24 P10000	60	CHF	12'411	12'840	0.09
DE000C6Y0W57	SMI 03/15/24 P10400	80	CHF	19'677	15'048	0.10
				51'084	31'650	0.22
	DE					
DE000C6PDAC1	SX5E 03/15/24 P3900	80	EUR	11'091	6'338	0.04
DE000C6JLQ93	SX5E 12/15/23 P3750	80	EUR	12'298	1'883	0.01
DE000C6EXLQ0	SX5E 06/21/24 P3900	30	EUR	3'352	3'908	0.03
				26'741	12'129	0.08
	JP					
	NKY 03/08/24 P26500	1'000	JPY	6'240	1'686	0.01
	NKY 06/14/24 P29000	1'000	JPY	5'941	6'161	0.04
				12'181	7'847	0.05
	US					
	SPX 06/21/24 P4050	300	USD	24'838	35'117	0.24
	SPX 12/15/23 P3600	300	USD	40'734	3'293	0.02
	SPX 03/15/24 P3750	200	USD	24'492	8'727	0.06

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
				90'064	47'138	0.32
Summe - Optionen					98'764	
Summe - Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					13'316'673	
Anlagefonds						
LU						
LU1877924016	SWC (LU) BF Sustainable Global Credit NT	11'566	CHF	1'343'694	1'110'459	7.57
LU0866272569	SWC (LU) EF Sustainable Emerging Markets NT	4'511	USD	599'982	493'749	3.37
					1'943'676	10.94
Summe - Anlagefonds					1'604'208	
Summe - Anlagefonds					1'604'208	
SUMME DES WERTPAPIERBESTANDES					14'920'882	101.80

9 Erläuterungen

Erläuterung 1: Finanzberichte

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

Erläuterung 2: Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung

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

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

Devisenkurse

DKK	100.00 = CHF	12.98841400
USD	1.00 = CHF	0.91480000
CNY	1.00 = CHF	0.12556017
GBP	1.00 = CHF	1.11655914
IDR	1.00 = CHF	0.00005919
ZAR	1.00 = CHF	0.04855781
AUD	1.00 = CHF	0.59041192
EUR	1.00 = CHF	0.96854454
SAR	1.00 = CHF	0.24391740
SGD	1.00 = CHF	0.67023225
TWD	1.00 = CHF	0.02833909
CAD	1.00 = CHF	0.67662722
PLN	1.00 = CHF	0.20957377
SEK	100.00 = CHF	8.42031600
AED	1.00 = CHF	0.24905732
BRL	1.00 = CHF	0.18276992
HKD	1.00 = CHF	0.11680509
KRW	1.00 = CHF	0.00067793
INR	1.00 = CHF	0.01101621
MXN	1.00 = CHF	0.05263976
JPY	100.00 = CHF	0.61303400

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

Bewertungsgrundsätze:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

j) Berechnung des Nettoinventarwertes

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

k) Bewertung der Devisentermingeschäfte

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

l) Kapitalgewinne oder -verluste aus Wertpapiergeschäften

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

m) Partial Swinging Single Prices (PSSP)

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

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

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

Erläuterung 3: Verwaltungskommission

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

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

Im Geschäftsjahr belief sich die effektive pauschale Verwaltungskommission auf:

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

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

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

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

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

Erläuterung 5: Total Expense Ratio (TER)

Die unter 'Statistik' dieses Berichts ausgewiesene TER wurde gemäß den «Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der TER von kollektiven Kapitalanlagen», die von der AMAS - Asset Management Association Switzerland (Stand: 5. August 2021) herausgegeben wurden, ermittelt. Der Ausweis der PTR im Jahresbericht ist nicht mehr zwingend notwendig. Die TER ist für die letzten 12 Monate berechnet, die dem Datum dieses Berichts vorausgingen.

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

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

Erläuterung 6: Angaben über Devisentermingeschäfte

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

Währung	Käufe	Währung	Verkäufe	Fälligkeit	Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF)
CNY	362'800.38	CHF	3'000'000.00	4.12.2023	-12'318.29
AUD	199'440.15	CHF	350'000.00	4.12.2023	-6'235.48
JPY	826'398.22	CHF	135'000'000.00	4.12.2023	-4'203.08
CAD	193'457.10	CHF	300'000.00	4.12.2023	-8'297.06
DKK	115'149.89	CHF	900'000.00	4.12.2023	-1'343.19
USD	5'141'813.94	CHF	5'880'000.00	4.12.2023	-200'108.86
GBP	554'049.00	CHF	500'000.00	4.12.2023	-592.11
EUR	1'809'024.20	CHF	1'900'000.00	4.12.2023	-23'673.88

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

Erläuterung 7: Angaben über Termingeschäfte

In der Berichtsperiode nicht relevant

Erläuterung 8: Eventualverpflichtungen aus Optionen

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

Währung	Put/Call	Strike	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Bezeichnung	Marktwert
EUR	Put	3'750.00	8	15.12.2023	EURO STOXX 50 PR (Not Licensed)	1'882.85
CHF	Put	10'250.00	6	15.12.2023	Swiss Market Index SMI PR	3'762.00
USD	Put	3'600.00	3	15.12.2023	S&P 500 PR	3'293.28
EUR	Put	3'900.00	8	15.03.2024	EURO STOXX 50 PR (Not Licensed)	6'338.16
CHF	Put	10'400.00	8	15.03.2024	Swiss Market Index SMI PR	15'048.00
JPY	Put	29'000.00	1	14.06.2024	Nikkei 225 PR	6'160.99
JPY	Put	26'500.00	1	08.03.2024	Nikkei 225 PR	1'685.84
EUR	Put	3'900.00	3	21.06.2024	EURO STOXX 50 PR (Not Licensed)	3'908.08
CHF	Put	10'000.00	6	21.06.2024	Swiss Market Index SMI PR	12'840.00
USD	Put	4'050.00	3	21.06.2024	S&P 500 PR	35'117.34
USD	Put	3'750.00	2	15.03.2024	S&P 500 PR	8'727.19

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

Erläuterung 9: Swapgeschäfte

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

Interest rate swap

Währung	Nominal	Bezeichnung	Währung	Nicht realisiertes Ergebnis (in CHF)
Verkauf	(1'000'000)	IRS Floating Leg - USD-SOFR-COMPOUND	USD	-914'800.00
Kauf	1'000'000	IRS Fix Leg 4.14334% p.a USD		905'376.75

Erläuterung 10: Wertpapierbestandsveränderungen

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

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

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

Erläuterung 12: Transaktionskosten

Transaktionskosten werden nur in Jahresbericht angezeigt.

Erläuterung 13: Wertpapierleihe (Securities Lending)

Keinen Securities Lending vorhanden.

Erläuterung 14: Gebühren bei Zeichnung und Rückkauf von Zielfonds

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

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

Zielfonds	Marktwert (in CHF)
Swisscanto (LU) Bond Fund Sustainable Global Credit	2'454'152.89
Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets	1'093'731.27

Erläuterung 15: Zusätzliche Informationen

Auflegung neuer Anteilklasse

Die folgende Anteilsklassen waren während der Geschäftsperiode aufgelegt:

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets ST: 18. April 2023 aktiviert.

Erläuterung 16: Wichtige Ereignisse

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

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

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

Erläuterung 17: Nachfolgende Ereignisse

In der Berichtsperiode nicht relevant.

10 Ungeprüfte Informationen

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

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