

Swisscanto (LU)

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30.09.2024

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

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

Depotbank: CACEIS Investor Services Bank S.A.

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

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

Inhaltsverzeichnis

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

1 Verwaltung und Organe

Verwaltungsgesellschaft

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

Verwaltungsrat

Präsident

Hans Frey, Schweiz, Geschäftsführer Swisscanto Fondsleitung AG, Zürich

Mitglieder

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

Geschäftsführung

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

Depotbank, Hauptzahl-, Register- und Transferstelle

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

Zentralverwaltungsstelle

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

Portfolio Manager

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

Zahl- und Vertriebsstellen

Deutschland

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

Liechtenstein

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

Luxemburg

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

Österreich

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

Zahlstelle in der Schweiz

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

Vertreterstelle in der Schweiz

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

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

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

2 Allgemeine Informationen

Anlagefonds nach luxemburgischem Recht „Umbrella Construction“

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

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

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

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

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

Verkaufsbeschränkungen

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

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

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

Risikomanagementverfahren

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

3 Aktivitätsbericht

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets - USD

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

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - USD

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

4 Vermögensaufstellung

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

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

Entwicklung der Anzahl Anteile

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets - USD

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

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

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

5 Ertrags- und Aufwandsrechnung und andere Veränderungen des Nettovermögens

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

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil dieses Berichtes.

6 Statistik

Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets - USD

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

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

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

7 Swisscanto (LU) Equity Fund Sustainable Emerging Markets

Wertpapierbestand zum 30.09.2024 (Angaben in USD)

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
Amtlich notierte sowie an anderen geregelten Märkten gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						
Aktien						
AE						
AEE000401019	EMIRATES TELECOM GROUP CO	1'449'339	AED	6'934'757	7'299'965	0.98
AEA002001013	ALDAR PROPERTIES PJSC	3'239'017	AED	6'086'319	6'631'475	0.89
AEA000201011	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2'525'797	AED	6'042'817	5'790'147	0.78
				19'063'893	19'721'587	2.65
AT						
AT0000652011	ERSTE GROUP BANK AG	191'337	EUR	9'241'687	10'516'894	1.41
				9'241'687	10'516'894	1.41
BR						
BRWEGEACNORO	WEG SA	656'745	BRL	4'721'109	6'559'249	0.88
BRBSBPACNOR5	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	478'817	BRL	7'017'211	7'948'338	1.07
BRITUBACNPR1	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	440'983	BRL	2'681'032	2'924'069	0.39
BRHYEACNORO	HYPERA SA	1'075'384	BRL	6'902'678	5'179'647	0.69
BRBBASACNOR3	BANCO DO BRASIL S.A.	1'588'645	BRL	7'218'696	7'928'931	1.06
				28'540'725	30'540'234	4.09
CA						
CA46579R1047	IVANHOE MINES LTD-CL A	548'469	CAD	7'748'417	8'168'471	1.10
				7'748'417	8'168'471	1.10
CN						
KYG9830F1063	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	106'268	HKD	191'358	189'073	0.03
KYG8918W1069	TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	3'043'200	HKD	7'514'861	7'820'054	1.05
KYG875721634	TENCENT HOLDINGS LTD	852'515	HKD	37'000'940	48'796'674	6.53
KYG8208B1014	JD.COM INC-CLASS A	579'150	HKD	10'928'409	12'459'088	1.67
KYG017191142	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2'680'472	HKD	31'876'977	37'959'693	5.08
HK0992009065	LENOVO GROUP LTD	8'588'000	HKD	9'609'205	11'719'704	1.57
CNE100006M58	MIDEA GROUP CO LTD	436'000	HKD	3'831'573	4'167'750	0.56
CNE1000048K8	HAIER SMART HOME CO LTD-H	2'869'000	HKD	9'556'410	11'524'017	1.54
CNE100003662	CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	293'560	CNY	8'741'706	10'565'585	1.42
CNE100002TP9	PROYA COSMETICS CO LTD-A	848'395	CNY	12'492'649	13'345'403	1.79
CNE100001QQ5	MIDEA GROUP CO LTD-A	532'400	CNY	4'970'416	5'786'022	0.78
CNE1000018M7	SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	667'680	CNY	6'466'686	9'500'057	1.27
CNE1000003X6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	3'327'371	HKD	18'199'324	21'482'801	2.88
CNE1000002H1	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	22'721'000	HKD	14'819'582	17'199'804	2.31
CNE000001KM8	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD-A	379'900	CNY	3'734'694	4'011'432	0.54
CNE000001G38	NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3'037'381	CNY	8'764'621	12'008'649	1.61
				188'699'410	228'535'806	30.63
GB						
GB00BMWC6P49	MONDI PLC	585'921	GBP	11'766'342	11'167'996	1.50
				11'766'342	11'167'996	1.50
ID						
ID1000129000	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	41'674'290	IDR	8'526'168	8'230'235	1.10

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

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

8 Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection

Wertpapierbestand zum 30.09.2024 (Angaben in CHF)

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

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

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

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

ISIN Nummer	Bezeichnung	Stückzahl / Nennwert	Währung	Einstandswert	Marktwert	% des Netto- vermögens
XS2189767515	KBN 1 1/8 06/14/30 REGS	204'000	USD	184'125	148'827	1.09
	NZ			387'733	327'168	2.39
XS2343772724	ASBBNK 0 1/4 05/21/31 EMTN	100'000	EUR	84'129	79'634	0.58
	SE			84'129	79'634	0.58
XS2474788929	KOMINS 2 3/4 03/01/25 REGS	300'000	USD	252'958	251'162	1.83
	SG			252'958	251'162	1.83
XS2310058891	DBSSP 1.822 03/10/31 GMTN	300'000	USD	277'004	243'246	1.77
	US			277'004	243'246	1.77
XS2439004685	PLD 1 1/2 02/08/34	100'000	EUR	76'184	79'461	0.58
XS0291949120	T 5 1/2 03/15/27	150'000	GBP	230'172	172'418	1.26
US94973VBF31	ELV 5.1 01/15/44	100'000	USD	121'789	83'480	0.61
US92826CAL63	V 1.9 04/15/27	350'000	USD	343'666	282'122	2.06
US92343VGK44	VZ 3.4 03/22/41	250'000	USD	238'897	172'441	1.26
US883556CL42	TMO 2 10/15/31	100'000	USD	76'901	73'127	0.53
US713448EP96	PEP 2 7/8 10/15/49	200'000	USD	136'920	120'817	0.88
US594918BR43	MSFT 2.4 08/08/26	150'000	USD	151'737	123'464	0.90
US594918BD56	MSFT 3 3/4 02/12/45	450'000	USD	371'913	347'616	2.53
US532457BY33	LLY 2 1/4 05/15/50	100'000	USD	60'755	53'193	0.39
US46647PBH82	JPM 2.005 03/13/26	100'000	USD	83'670	83'221	0.61
US172967MD09	C 4.65 07/23/48	100'000	USD	101'281	79'768	0.58
US09247XAQ43	BLK 2.4 04/30/30	200'000	USD	157'100	154'468	1.13
US04636NAE31	AZN 1 3/4 05/28/28	100'000	USD	81'191	77'914	0.57
US02079KAF49	GOOGL 2.05 08/15/50	200'000	USD	112'669	105'179	0.77
US001055AY85	AFL 4 3/4 01/15/49	100'000	USD	88'757	79'568	0.58
	XS			2'433'602	2'088'255	15.24
XS2707161308	IBRD 2 1/2 01/13/31 EMTN	1'000'000	CNY	123'413	122'131	0.89
XS2288938546	EBRD 2 01/21/25 GMTN	1'000'000	CNY	140'889	120'597	0.88
XS0307424274	ASIA 2.35 06/21/27 GMTN	30'000'000	JPY	288'137	187'233	1.37
XS0282506657	EIB 2.15 01/18/27	20'000'000	JPY	189'193	122'956	0.90
US4581X0BX51	IADB 3.2 08/07/42	100'000	USD	67'820	72'454	0.53
EU000A3K4DD8	EU 1 07/06/32 NGEU	100'000	EUR	85'731	83'844	0.61
				895'184	709'215	5.18
Summe - Anleihen					6'347'919	
Optionen						
	CH					
DE000F0HBFW9	SMI 06/20/25 P10900	60	CHF	13'521	11'538	0.08
DE000C763PD3	SMI 03/21/25 P10900	60	CHF	9'621	6'114	0.04
DE000C4SKJF9	SMI 12/20/24 P10600	60	CHF	10'341	2'034	0.01
				33'484	19'686	0.13
	DE					
DE000F0UHCM7	SX5E 06/20/25 P4450	60	EUR	6'281	6'044	0.04
DE000F0SDXJ2	SX5E 03/21/25 P4450	40	EUR	3'596	2'467	0.02

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

9 Erläuterungen

Erläuterung 1: Finanzberichte

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

Erläuterung 2: Wichtigste Grundsätze der Rechnungslegung

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

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

Devisenkurse

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

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

Bewertungsgrundsätze:

a) Wertpapiere, Derivate und andere Anlagen, welche an einer Börse notiert sind, werden zu den letztbekannten 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 Markttrendite 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, marktkonforme Courtagen, Kommissionen, Abgaben usw.) mitberücksichtigt. Falls an einem Bankgeschäftstag die Summe der Zeichnungen bzw. Rücknahmen aller Anteilklassen eines Teilfonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, welcher einen bestimmten Schwellenwert (dargestellt in Prozent des Nettovermögenswertes) überschreitet, wird der Nettovermögenswert des betreffenden Teilfonds erhöht bzw. reduziert. Diese Summe wird als «modifizierter Nettoinventarwert» bezeichnet. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettovermögenswertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl der Anteile des betroffenen Teilfonds führen. Sie resultiert in einer Verminderung des Nettovermögenswertes, wenn die Nettobewegungen einen Rückgang der Anzahl der Anteile bewirken.

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

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

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

Erläuterung 3: Verwaltungskommission

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

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

Im Geschäftsjahr belief sich die effektive pauschale Verwaltungskommission auf:

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

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

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

Gemäß den in Luxemburg geltenden Bestimmungen unterliegt der Fonds einer vierteljährlich zahlbaren „Taxe d'abonnement“ in Höhe von 0,05% p.a. für die Anteile der 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 OGAW¹ angelegt ist, die bereits zur Zahlung der Kapitalsteuer verpflichtet sind, von dieser Steuer befreit.

Erläuterung 5: Total Expense Ratio (TER)

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

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

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

Erläuterung 6: Angaben über Devisentermingeschäfte

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

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

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

Erläuterung 7: Angaben über Termingeschäfte

In der Berichtsperiode nicht relevant.

Erläuterung 8: Eventualverpflichtungen aus Optionen

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

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

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

Erläuterung 9: Swapgeschäfte

Swisscanto (LU) Portfolio Fund Sustainable Protection - CHF

Interest rate swap

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

Erläuterung 10: Wertpapierbestandsveränderungen

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

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

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

Erläuterung 12: Transaktionskosten

Transaktionskosten werden nur in Jahresbericht angezeigt.

Erläuterung 13: Wertpapierleihe (Securities Lending)

Keinen Securities Lending vorhanden.

Erläuterung 14: Gebühren bei Zeichnung und Rückkauf von Zielfonds

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

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

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

Erläuterung 15: Zusätzliche Informationen

In der Berichtsperiode nicht relevant.

Erläuterung 16: Wichtige Ereignisse

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

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

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

Erläuterung 17: Nachfolgende Ereignisse

In der Berichtsperiode nicht relevant.

10 Ungeprüfte Informationen

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

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